

AWMZ Fund

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts (Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen») mit den folgenden Teilvermögen:

AWMZ Fund I

AWMZ Fund II

Halbjahresbericht per 30. September 2023

2 AWMZ Fund

Halbjahresbericht per 30. September 2023

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
AWMZ Fund I	4
AWMZ Fund II	13
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	22

Verwaltung und Organe

Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident (ab 1. März 2023)
- Luca Diener, Vizepräsident
- Patrick Tschumper, Mitglied (ab 1. März 2023)
- Jürg Roth, Mitglied
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Thomas Vonaesch, Mitglied
- Hans Peter Bär, Mitglied (ab 01. April 2023)

Geschäftsleitung

- Thomas Schärer, CEO
- Emil Stark, stellvertretender CEO und Leiter Fund Solutions AM
- Gilbert Eyb, Mitglied, Legal
- Naftali Halonbrenner, Mitglied, Fund Services
- Hans Christoph Nickl, Mitglied, COO
- David Dubach, Mitglied, Oversight & ManCo Services
- Gabriele Wyss, Mitglied, Compliance
- Christian Bieri, Mitglied, Real Estate Fund Management
- Marcus Eberlein, Mitglied, Performance & Risk Management
- Ralph Warth, Mitglied, Fund Solutions PLF

Depotbank

Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG, Zürich

Informationen über Dritte

Übertragung der Anlageentscheide

Die Fondsleitung hat die Anlageentscheide an die Aquila AG, Zürich, als Vermögensverwalterin übertragen.

Die Vermögensverwalterin ist berechtigt, verbundene Gesellschaften oder Dritte als Anlageberater ohne Entscheidungsfähigkeit beizuziehen. Zurzeit fungiert die Gruppengesellschaft Aquila Wealth Management AG, Zürich als Anlageberaterin.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben der Fondsadministration an nachfolgende Gruppengesellschaften der UBS Group AG übertragen:

- Credit Suisse AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Rechts- und Complianceberatung, Facility Management und Management Information System MIS.
- Credit Suisse (Schweiz) AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Personalwesen Collateral Management, IT Dienstleistungen und First Line of Defense Support (FLDS).
- Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Schweiz: Real Estate Administration (u.a. Fonds- und Liegenschaftsbuchhaltung, Liegenschaftenverwaltung).
- Credit Suisse Services AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Finanzwesen der Fondsleitung und Steuerberatung.
- Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxembourg: Teilaufgaben im Bereich der Fondsbuchhaltung sowie Unterstützung bei der Überwachung der Anlagevorschriften.
- Credit Suisse (Poland) Sp.z.o.o., Polen: Teilaufgaben in den Bereichen Fondsbuchhaltung, Information Management (u.a. Produkt-Masterdaten, Preis-Publikationen, Factsheet-Produktion, Basisinformationsblatt-Produktion und Erstellen von Reportings), Legal Reporting (Erstellung des Jahresberichts) sowie weitere Supportaufgaben.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und den genannten Gruppengesellschaften abgeschlossener Vertrag. Es besteht die Möglichkeit, den genannten Gruppengesellschaften weitere Teilaufgaben zu übertragen.

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	30.09.2023	31.03.2023	31.03.2022
Nettofondsvermögen in Mio.	USD	49.21	54.24	71.46
Inventarwert pro Anteil	USD	586.47	641.82	756.69

Wechselkurse

Wechselkurse per	30.09.2023
EURO	1.058750
KANADISCHER DOLLAR	0.739660
SCHWEIZER FRANKEN	1.093129
US DOLLAR	1.000000

Vermögensrechnung per 30. September 2023

	30.09.2023	31.03.2023
	USD	USD
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	12'301'559.78	1'954'028.80
Geldmarktinstrumente	2'980'266.69	9'455'822.10
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Strukturierte Produkte	5'159'122.31	8'651'188.51
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	30'002'504.34	32'307'186.62
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	3'108'632.36	3'757'959.29
Derivative Finanzinstrumente	-4'371'145.00	-1'806'495.00
Sonstige Vermögenswerte	116'738.35	25'920.50
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	49'297'678.83	54'345'610.82
Andere Verbindlichkeiten	83'145.02	101'926.16
Nettofondsvermögen	49'214'533.81	54'243'684.66
	01.04.2023 -	01.04.2022 -
	30.09.2023	31.03.2023
	USD	USD
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	54'243'684.66	71'463'802.25
Ablieferung Verrechnungssteuer	-111'476.09	0.00
Rücknahmen von Anteilen	-362'718.00	-7'599'999.02
Sonstiges aus Anteilverkehr	-21'581.54	88'541.00
Gesamterfolg	-4'533'375.22	-9'708'659.57
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	49'214'533.81	54'243'684.66
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	84'516.000	94'442.761
Zurückgenommene Anteile	-600.000	-9'926.761
Bestand am Ende der Berichtsperiode	83'916.000	84'516.000
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil	586.47	641.82

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023

	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
	USD	USD
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	66'775.10	71'165.39
Negativzinsen	0.00	-591.98
Erträge der Geldmarktinstrumenten	156'416.90	222'108.33
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Strukturierte Produkte	22'318.81	509'175.40
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien	304'817.94	386'604.22
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	617.55
Total Erträge	550'328.75	1'189'078.91
Aufwendungen		
Passivzinsen	1'351.35	3'359.46
Prüfaufwand	8'778.93	15'490.42
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	474'896.63	1'074'487.30
- die Depotbank	12'835.05	29'040.16
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-102'514.86	-249'680.67
Sonstige Aufwendungen	564.02	1'769.09
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	348.26	-3'889.97
Total Aufwendungen	396'259.38	870'575.79
Nettoertrag	154'069.37	318'503.12
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-7'307'798.77	-3'191'220.65
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-102'514.86	-249'680.67
Realisierter Erfolg	-7'256'244.26	-3'122'398.20
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2'722'869.04	-6'586'261.37
Gesamterfolg	-4'533'375.22	-9'708'659.57

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)							
KANADISCHER DOLLAR							
KUUHUBB INC	CAD	2'895'000			2'895'000	42'826.34	0.09
						42'826.34	0.09
US DOLLAR							
ALPHABET -A-	USD	30'000			30'000	3'925'800.00	7.96
AMAZON.COM	USD	30'000		6'000	24'000	3'050'880.00	6.19
APPLE	USD	20'000		4'000	16'000	2'739'360.00	5.56
AT&T	USD	110'000		110'000			
DEVON ENERGY	USD	18'000			18'000	858'600.00	1.74
EQT CORP	USD	40'000		40'000			
HUNTINGTON	USD	8'000			8'000	1'636'640.00	3.32
IBM	USD	14'000			14'000	1'964'200.00	3.98
LOCKHEED MARTIN	USD		5'600	800	4'800	1'963'008.00	3.98
MICROSOFT	USD	13'000		3'000	10'000	3'157'500.00	6.40
MICROSTRATEGY -A-	USD	4'200			4'200	1'378'776.00	2.80
NEWMONT MINING	USD	50'000		50'000			
NORTHROP GRUMMAN	USD	5'600			5'600	2'465'064.00	5.00
NVIDIA	USD		1'000		1'000	434'990.00	0.88
PETROLEO BRASILEIRO ADR	USD		150'000		150'000	2'248'500.00	4.56
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	USD	11'700	8'300		20'000	1'439'400.00	2.92
TESLA MOTORS	USD	2'000		2'000			
VALERO ENERGY	USD	14'000			14'000	1'983'940.00	4.02
VERIZON COMMUNICATIONS	USD	36'000	8'000	22'000	22'000	713'020.00	1.45
						29'959'678.00	60.77
Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)						30'002'504.34	60.86
Kollektive Kapitalanlagen							
US DOLLAR							
ZKB GOLD ETF -A-	USD	1'400		200	1'200	2'092'320.00	4.24
						2'092'320.00	4.24
Total Kollektive Kapitalanlagen						2'092'320.00	4.24
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						32'094'824.34	65.10
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Kollektive Kapitalanlagen							
US DOLLAR							
AWMZ GLOBAL INVESTMENTS SPC - AWMZ GLOBAL MARKETS I SEG PORT	USD	1'500			1'500	447'201.75	0.91
AWMZ GLOBAL INVESTMENTS SPC - AWMZ GLOBAL MARKETS I SEG PORT	USD	1'900			1'900	569'110.61	1.15
						1'016'312.36	2.06
Total Kollektive Kapitalanlagen						1'016'312.36	2.06
Geldmarktinstrumente							
US DOLLAR							
TREASURY BILL 0%/22-11.05.2023	USD	7'000'000		7'000'000			
TREASURY BILL 0%/22-27.04.2023	USD	2'500'000		2'500'000			
TREASURY BILL 0%/23-14.11.2023	USD		3'000'000		3'000'000	2'980'266.69	6.05
TREASURY BILL 0%/23-15.08.2023	USD		7'000'000	7'000'000			
TREASURY BILL 0%/23-26.10.2023	USD		1'000'000	1'000'000			
TREASURY BILL 0%/23-27.07.2023	USD		2'500'000	2'500'000			
						2'980'266.69	6.05
Total Geldmarktinstrumente						2'980'266.69	6.05
Strukturierte Produkte							
SCHWEIZER FRANKEN							
MYTHEN PCC LIMITED/22-PERPETUAL	CHF	20'000			20'000	2'433'086.31	4.94
						2'433'086.31	4.94
US DOLLAR							
BNP PARIBAS 0%/23-01.05.2023	USD	4'100'000		4'100'000			
BNP PARIBAS 0%/23-12.07.2023	USD		4'100'000	4'100'000			
BNP PARIBAS 0%/23-16.10.2023	USD		3'250'000	3'250'000			
BNP PARIBAS 0%/23-27.11.2023	USD		3'350'000	3'350'000			
MYTHEN PCC LIMITED/22-PERPETUAL	USD	23'600			23'600	2'726'036.00	5.53
						2'726'036.00	5.53
Total Strukturierte Produkte						5'159'122.31	10.47
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						9'155'701.36	18.57

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Derivative Finanzinstrumente							
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Options							
US DOLLAR							
ADVANCED MICRO DEVICES (put) -115- 20.10.23	USD		100	100			
ADVANCED MICRO DEVICES (put) -125- 21.07.23	USD		100	100			
ALPHABET a (call) -100- 16.06.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -105- 19.05.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -110- 19.05.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -110- 21.07.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -115- 19.05.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -120- 18.08.23	USD		600	600			
ALPHABET a (call) -120- 21.07.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -125- 18.08.23	USD		600	600			
ALPHABET a (call) -125- 20.10.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -130- 15.12.23	USD		300	600	-300	-248'400.00	-0.50
ALPHABET a (call) -130- 18.08.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -135- 15.12.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -135- 20.10.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -140- 15.12.23	USD		600	600			
AMAZON.COM (call) -105- 16.06.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -110- 19.05.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -110- 21.07.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -115- 21.07.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -125- 15.12.23	USD			240	-240	-242'400.00	-0.49
AMAZON.COM (call) -125- 18.08.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -130- 15.12.23	USD		240	240			
AMAZON.COM (call) -135- 18.08.23	USD		600	600			
AMAZON.COM (call) -135- 20.10.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -140- 15.12.23	USD		540	540			
AMAZON.COM (call) -145- 20.10.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -150- 15.12.23	USD		300	300			
APPLE (call) -165- 16.06.23	USD		200	200			
APPLE (call) -170- 15.12.23	USD			160	-160	-154'080.00	-0.31
APPLE (call) -170- 18.08.23	USD		200	200			
APPLE (call) -170- 19.05.23	USD	-200	200				
APPLE (call) -175- 20.10.23	USD		160	160			
APPLE (call) -175- 21.07.23	USD		200	200			
APPLE (call) -180- 15.12.23	USD		320	320			
APPLE (call) -185- 20.10.23	USD		120	120			
APPLE (call) -190- 15.12.23	USD		160	160			
APPLE (put) -180- 18.08.23	USD		200	200			
CBOE VIX (call) -20- 19.07.23	USD		400	400			
CBOE VIX (put) -20- 19.07.23	USD		100	100			
DEVON ENERGY (put) -50- 15.09.23	USD		180	180			
DEVON ENERGY (put) -50- 17.11.23	USD		180	180			
DEVON ENERGY (put) -50- 21.07.23	USD		180	180			
DEVON ENERGY (put) -55- 15.09.23	USD		180	180			
DEVON ENERGY (put) -55- 16.06.23	USD	-200	200				
DEVON ENERGY (put) -55- 17.11.23	USD			180	-180	-135'000.00	-0.27
IBM (call) -145- 15.12.23	USD			140	-140	-42'700.00	-0.09
IBM (call) -150- 17.11.23	USD		140	140			
LOCKHEED MARTIN (call) -430- 15.12.23	USD			48	-48	-27'840.00	-0.06
LOCKHEED MARTIN (call) -460- 15.12.23	USD		48	48			
LOCKHEED MARTIN (call) -490- 15.12.23	USD		48	48			
LOCKHEED MARTIN (put) -480- 16.06.23	USD	-56	56				
LOCKHEED MARTIN (put) -500- 15.09.23	USD		56	56			
LOCKHEED MARTIN (put) -500- 16.06.23	USD		56	56			
MICROSOFT (call) -280- 16.06.23	USD		130	130			
MICROSOFT (call) -295- 19.05.23	USD	-130	130				
MICROSOFT (call) -300- 16.06.23	USD		130	130			
MICROSOFT (call) -310- 15.12.23	USD			100	-100	-200'800.00	-0.41
MICROSOFT (call) -310- 21.07.23	USD		130	130			
MICROSOFT (call) -315- 18.08.23	USD		130	130			
MICROSOFT (call) -315- 20.10.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -320- 15.12.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -325- 18.08.23	USD		130	130			
MICROSOFT (call) -330- 15.12.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -330- 18.08.23	USD		100	100			

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
MICROSOFT (call) -330- 20.10.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -340- 15.12.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -340- 18.08.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -345- 15.09.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -350- 18.08.23	USD		200	200			
MICROSOFT (call) -350- 21.07.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -370- 15.09.23	USD		100	100			
MICROSTRATEGY a (put) -330- 19.05.23	USD	-21	21				
MICROSTRATEGY a (put) -340- 19.05.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -340- 21.04.23	USD	-21	21				
MICROSTRATEGY a (put) -350- 16.06.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -350- 21.07.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -360- 16.06.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -360- 19.05.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -370- 19.05.23	USD		21	21			
MICROSTRATEGY a (put) -380- 21.07.23	USD		42	42			
MICROSTRATEGY a (put) -400- 15.12.23	USD			21	-21	-176'400.00	-0.36
MICROSTRATEGY a (put) -420- 15.12.23	USD			21	-21	-210'525.00	-0.43
MICROSTRATEGY a (put) -420- 18.08.23	USD		42	42			
MICROSTRATEGY a (put) -450- 15.09.23	USD		62	62			
MICROSTRATEGY a (put) -470- 18.08.23	USD		42	42			
NASDAQ 100 (call) -12400- 16.06.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -12400- 19.05.23	USD	-10	10				
NASDAQ 100 (call) -13400- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -13600- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14000- 20.10.23	USD			20	-20	-1'698'600.00	-3.45
NASDAQ 100 (call) -14100- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -14300- 20.10.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -14300- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -14500- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14500- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14500- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14600- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14600- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14700- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14700- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14800- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14800- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -14900- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15000- 20.10.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -15000- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (call) -15100- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15200- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15300- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15300- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15500- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15700- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -11000- 29.12.23	USD		20		20	51'800.00	0.11
NASDAQ 100 (put) -11700- 16.06.23	USD		60	60			
NASDAQ 100 (put) -11700- 19.05.23	USD	60		60			
NASDAQ 100 (put) -12500- 16.06.23	USD		50	50			
NASDAQ 100 (put) -13000- 16.06.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -13000- 19.05.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -13000- 21.07.23	USD		40	40			
NASDAQ 100 (put) -13200- 19.05.23	USD	-10	30	20			
NASDAQ 100 (put) -13300- 16.06.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -13500- 16.06.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -13500- 17.11.23	USD		30		30	232'950.00	0.47
NASDAQ 100 (put) -13600- 21.07.23	USD		60	60			
NASDAQ 100 (put) -13800- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14000- 20.10.23	USD		20		20	149'200.00	0.30
NASDAQ 100 (put) -14000- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -14300- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -14400- 18.08.23	USD		50	50			
NASDAQ 100 (put) -14500- 15.09.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -14500- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -14500- 20.10.23	USD		50	30	20	264'600.00	0.54
NASDAQ 100 (put) -14600- 21.07.23	USD		60	60			
NASDAQ 100 (put) -14800- 17.11.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14800- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15000- 15.09.23	USD		30	30			

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
NASDAQ 100 (put) -15000- 17.11.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15000- 18.08.23	USD		40	40			
NASDAQ 100 (put) -15000- 20.10.23	USD			10	-10	-303'950.00	-0.62
NASDAQ 100 (put) -15000- 21.07.23	USD		60	60			
NASDAQ 100 (put) -15100- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15200- 17.11.23	USD			20	-20	-1'098'260.00	-2.23
NASDAQ 100 (put) -15300- 15.09.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15300- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15300- 20.10.23	USD		10	20	-10	-583'200.00	-1.18
NASDAQ 100 (put) -15300- 21.07.23	USD		40	40			
NASDAQ 100 (put) -15400- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15400- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15500- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15600- 20.10.23	USD		30	30			
NASDAQ 100 (put) -15600- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15700- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15800- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15800- 20.10.23	USD		40	40			
NASDAQ 100 (put) -15900- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15900- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -16000- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -16100- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -9500- 29.12.23	USD		20	20			
NORTHROP GRUMMAN (call) -430- 17.11.23	USD			56	-56	-128'800.00	-0.26
NORTHROP GRUMMAN (call) -450- 17.11.23	USD		56	56			
NORTHROP GRUMMAN (call) -450- 18.08.23	USD		56	56			
NORTHROP GRUMMAN (call) -480- 16.06.23	USD	-56	56				
NORTHROP GRUMMAN (call) -480- 17.11.23	USD		56	56			
NVIDIA (call) -430- 15.12.23	USD			10	-10	-42'150.00	-0.09
NVIDIA (call) -520- 15.12.23	USD		10	10			
NVIDIA (put) -520- 15.12.23	USD		10	10			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -14- 20.10.23	USD		1'000	1'000			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -15- 18.08.23	USD		1'500	1'500			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -15- 20.10.23	USD			1'500	-1'500	-73'500.00	-0.15
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -11- 16.06.23	USD		400	400			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -11- 19.05.23	USD		800	800			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 16.06.23	USD		800	800			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 19.05.23	USD		800	800			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 21.07.23	USD		800	800			
QUALCOMM (put) -120- 17.11.23	USD		120	120			
QUALCOMM (put) -130- 18.08.23	USD		120	120			
QUALCOMM (put) -135- 15.09.23	USD		120	120			
S&P 500 (put) -3750- 21.04.23	USD	100		100			
S&P 500 (put) -3800- 16.06.23	USD		80	80			
S&P 500 (put) -3850- 19.05.23	USD		80	80			
S&P 500 (put) -3950- 21.07.23	USD		100	100			
S&P 500 (put) -4100- 16.06.23	USD		10	10			
S&P 500 (put) -4100- 21.07.23	USD		60	60			
S&P 500 (put) -4200- 16.06.23	USD		10	10			
S&P 500 (put) -4200- 18.08.23	USD		40	40			
S&P 500 (put) -4200- 20.10.23	USD		60		60	184'740.00	0.37
S&P 500 (put) -4200- 21.07.23	USD		40	40			
S&P 500 (put) -4250- 06.10.23	USD		50	50			
S&P 500 (put) -4280- 17.11.23	USD		30		30	246'570.00	0.50
S&P 500 (put) -4360- 20.10.23	USD		60	60			
S&P 500 (put) -4400- 20.10.23	USD		20	20			
S&P 500 (put) -4415- 15.09.23	USD		40	40			
S&P 500 (put) -4450- 18.08.23	USD		40	40			
TESLA MOTORS (call) -170- 19.05.23	USD		20	20			
TESLA MOTORS (call) -180- 21.04.23	USD	-20	20				
UNITED TECHNOLOGIES CORP (put) -110- 19.05.23	USD	-83	83				
VALERO ENERGY (call) -140- 15.12.23	USD			140	-140	-134'400.00	-0.27
VALERO ENERGY (call) -145- 15.09.23	USD		140	140			
VALERO ENERGY (call) -145- 19.05.23	USD	-140	140				
VALERO ENERGY (put) -110- 16.06.23	USD		60	60			
VALERO ENERGY (put) -115- 15.09.23	USD		60	60			
VALERO ENERGY (put) -115- 21.07.23	USD		60	60			
VALERO ENERGY (put) -125- 15.09.23	USD		60	60			
Total Options						-4'371'145.00	-8.87
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						-4'371'145.00	-8.87

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Total Derivative Finanzinstrumente						-4'371'145.00	-8.87
Total Anlagen						36'879'380.70	74.81
Bankguthaben auf Sicht						12'301'559.78	24.95
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						116'738.35	0.24
Gesamtfondsvermögen (GFV)						49'297'678.83	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						83'145.02	0.17
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettofondsvermögen						49'214'533.81	99.83

(1) Umfassen auch Corporate Actions

Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

Anlagekategorien	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	27'723'679.34	56.24
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	9'155'701.36	18.57
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

Ausserbilanzgeschäfte 1	30.09.2023		31.03.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	285'491'668.00	580.10%	164'244'803.00	302.79%
Total engagementerhöhende Positionen	285'491'668.00	580.10%	164'244'803.00	302.79%
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	285'491'668.00	580.10%	164'244'803.00	302.79%
Total engagementreduzierende Positionen	285'491'668.00	580.10%	164'244'803.00	302.79%

1 Die Berechnung des Basiswertäquivalent aus Optionen erfolgt mit einem Delta von 1 bzw. -1. Auf eine Verrechnung gegenläufiger Positionen wird verzichtet.

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	30.09.2023	31.03.2023	31.03.2022
Nettofondsvermögen in Mio.	USD	22.36	24.66	29.46
Inventarwert pro Anteil	USD	499.41	550.59	653.58

14 AWMZ Fund II

Halbjahresbericht per 30. September 2023

Wechselkurse

Wechselkurse per	30.09.2023
EURO	1.058750
KANADISCHER DOLLAR	0.739660
SCHWEIZER FRANKEN	1.093129
US DOLLAR	1.000000

Vermögensrechnung per 30. September 2023

	30.09.2023	31.03.2023
	USD	USD
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	4'228'590.19	255'468.77
Geldmarktinstrumente	1'490'133.33	4'012'515.74
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Strukturierte Produkte	2'675'778.95	3'699'346.57
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	14'744'776.87	15'528'078.74
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'365'032.36	2'078'559.29
Derivative Finanzinstrumente	-2'148'735.00	-872'525.00
Sonstige Vermögenswerte	51'259.55	9'698.77
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	22'406'836.25	24'711'142.88
Andere Verbindlichkeiten	42'976.64	55'594.89
Nettofondsvermögen	22'363'859.61	24'655'547.99
	01.04.2023 -	01.04.2022 -
	30.09.2023	31.03.2023
	USD	USD
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	24'655'547.99	29'460'508.30
Ablieferung Verrechnungssteuer	-32'201.86	0.00
Rücknahmen von Anteilen	0.00	-170'946.43
Sonstiges aus Anteilverkehr	0.00	-22'162.09
Gesamterfolg	-2'259'486.52	-4'611'851.79
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	22'363'859.61	24'655'547.99
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	44'780.382	45'075.845
Zurückgenommene Anteile	0.000	-295.463
Bestand am Ende der Berichtsperiode	44'780.382	44'780.382
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil	499.41	550.59

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023

	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
	USD	USD
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	22'016.72	27'620.12
Negativzinsen	0.00	-178.99
Erträge der Geldmarktinstrumenten	27'345.08	119'596.39
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Strukturierte Produkte	13'949.26	167'901.40
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien	147'312.16	179'862.10
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	264.66
Total Erträge	210'623.22	495'065.68
Aufwendungen		
Passivzinsen	1'289.41	2'655.77
Prüfaufwand	8'778.93	15'490.42
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	216'336.08	493'517.55
- die Depotbank	11'210.44	20'977.84
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-46'700.65	-131'523.36
Sonstige Aufwendungen	564.02	1'736.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	0.00	205.95
Total Aufwendungen	191'478.23	403'060.32
Nettoertrag	19'144.99	92'005.36
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-3'381'703.48	-1'422'837.45
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-46'700.65	-131'523.36
Realisierter Erfolg	-3'409'259.14	-1'462'355.45
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	1'149'772.62	-3'149'496.34
Gesamterfolg	-2'259'486.52	-4'611'851.79

Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)							
KANADISCHER DOLLAR							
KUUHUBB INC	CAD	2'670'000			2'670'000	39'497.87	0.18
						39'497.87	0.18
US DOLLAR							
ALPHABET -A-	USD	15'000			15'000	1'962'900.00	8.76
AMAZON.COM	USD	15'000		3'000	12'000	1'525'440.00	6.81
APPLE	USD	10'000		2'000	8'000	1'369'680.00	6.11
AT&T	USD	48'000		48'000			
DEVON ENERGY	USD	9'000			9'000	429'300.00	1.92
EQT CORP	USD	20'000		20'000			
HUNTINGTON	USD	4'000			4'000	818'320.00	3.65
IBM	USD	7'000			7'000	982'100.00	4.38
LOCKHEED MARTIN	USD		2'400		2'400	981'504.00	4.38
MICROSOFT	USD	6'500		1'500	5'000	1'578'750.00	7.05
MICROSTRATEGY -A-	USD	1'800			1'800	590'904.00	2.64
NEWMONT MINING	USD	20'000		20'000			
NORTHROP GRUMMAN	USD	2'400			2'400	1'056'456.00	4.71
NVIDIA	USD		500		500	217'495.00	0.97
PETROLEO BRASILEIRO ADR	USD		75'000		75'000	1'124'250.00	5.02
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	USD	5'800	4'200		10'000	719'700.00	3.21
TESLA MOTORS	USD	1'000		1'000			
VALERO ENERGY	USD	7'000			7'000	991'970.00	4.43
VERIZON COMMUNICATIONS	USD	18'000	4'000	11'000	11'000	356'510.00	1.59
						14'705'279.00	65.63
Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)						14'744'776.87	65.80
Kollektive Kapitalanlagen							
US DOLLAR							
ZKB GOLD ETF -A-	USD	500	190	490	200	348'720.00	1.56
						348'720.00	1.56
Total Kollektive Kapitalanlagen						348'720.00	1.56
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						15'093'496.87	67.36
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Kollektive Kapitalanlagen							
US DOLLAR							
AWMZ GLOBAL INVESTMENTS SPC - AWMZ GLOBAL MARKETS I SEG PORT	USD	1'500			1'500	447'201.75	2.00
AWMZ GLOBAL INVESTMENTS SPC - AWMZ GLOBAL MARKETS I SEG PORT	USD	1'900			1'900	569'110.61	2.54
						1'016'312.36	4.54
Total Kollektive Kapitalanlagen						1'016'312.36	4.54
Geldmarktinstrumente							
US DOLLAR							
TREASURY BILL 0%/22-11.05.2023	USD	2'000'000		2'000'000			
TREASURY BILL 0%/22-27.04.2023	USD	2'000'000		2'000'000			
TREASURY BILL 0%/23-14.11.2023	USD		1'500'000		1'500'000	1'490'133.33	6.65
TREASURY BILL 0%/23-15.08.2023	USD		2'000'000	2'000'000			
TREASURY BILL 0%/23-26.10.2023	USD		500'000	500'000			
TREASURY BILL 0%/23-27.07.2023	USD		1'750'000	1'750'000			
						1'490'133.33	6.65
Total Geldmarktinstrumente						1'490'133.33	6.65
Strukturierte Produkte							
SCHWEIZER FRANKEN							
MYTHEN PCC LIMITED/22-PERPETUAL	CHF	12'500			12'500	1'520'678.95	6.79
						1'520'678.95	6.79
US DOLLAR							
BNP PARIBAS 0%/23-01.05.2023	USD	1'200'000		1'200'000			
BNP PARIBAS 0%/23-12.07.2023	USD		1'200'000	1'200'000			
BNP PARIBAS 0%/23-16.10.2023	USD		950'000	950'000			
BNP PARIBAS 0%/23-27.11.2023	USD		955'000	955'000			
MYTHEN PCC LIMITED/22-PERPETUAL	USD	10'000			10'000	1'155'100.00	5.16
						1'155'100.00	5.16
Total Strukturierte Produkte						2'675'778.95	11.94
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						5'182'224.64	23.13

Halbjahresbericht per 30. September 2023

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Derivative Finanzinstrumente							
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Options							
US DOLLAR							
ADVANCED MICRO DEVICES (put) -115- 20.10.23	USD		50	50			
ADVANCED MICRO DEVICES (put) -125- 21.07.23	USD		50	50			
ALPHABET a (call) -100- 16.06.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -105- 19.05.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -110- 19.05.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -110- 21.07.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -115- 19.05.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -120- 18.08.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -120- 21.07.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -125- 18.08.23	USD		300	300			
ALPHABET a (call) -125- 20.10.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -130- 15.12.23	USD		150	300	-150	-124'200.00	-0.55
ALPHABET a (call) -130- 18.08.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -135- 15.12.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -135- 20.10.23	USD		150	150			
ALPHABET a (call) -140- 15.12.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -105- 16.06.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -110- 19.05.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -110- 21.07.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -115- 21.07.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -125- 15.12.23	USD			120	-120	-121'200.00	-0.54
AMAZON.COM (call) -125- 18.08.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -130- 15.12.23	USD		120	120			
AMAZON.COM (call) -135- 18.08.23	USD		300	300			
AMAZON.COM (call) -135- 20.10.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -140- 15.12.23	USD		270	270			
AMAZON.COM (call) -145- 20.10.23	USD		150	150			
AMAZON.COM (call) -150- 15.12.23	USD		150	150			
APPLE (call) -165- 16.06.23	USD		100	100			
APPLE (call) -170- 15.12.23	USD			80	-80	-77'040.00	-0.34
APPLE (call) -170- 18.08.23	USD		100	100			
APPLE (call) -170- 19.05.23	USD	-100	100				
APPLE (call) -175- 20.10.23	USD		80	80			
APPLE (call) -175- 21.07.23	USD		100	100			
APPLE (call) -180- 15.12.23	USD		160	160			
APPLE (call) -185- 20.10.23	USD		80	80			
APPLE (call) -190- 15.12.23	USD		80	80			
APPLE (put) -180- 18.08.23	USD		100	100			
CBOE VIX (call) -20- 19.07.23	USD		200	200			
CBOE VIX (put) -20- 19.07.23	USD		50	50			
DEVON ENERGY (put) -50- 15.09.23	USD		90	90			
DEVON ENERGY (put) -50- 17.11.23	USD		90	90			
DEVON ENERGY (put) -50- 21.07.23	USD		90	90			
DEVON ENERGY (put) -55- 15.09.23	USD		90	90			
DEVON ENERGY (put) -55- 16.06.23	USD	-100	100				
DEVON ENERGY (put) -55- 17.11.23	USD			90	-90	-67'500.00	-0.30
IBM (call) -145- 15.12.23	USD			70	-70	-21'350.00	-0.10
IBM (call) -150- 17.11.23	USD		70	70			
LOCKHEED MARTIN (call) -430- 15.12.23	USD			24	-24	-13'920.00	-0.06
LOCKHEED MARTIN (call) -460- 15.12.23	USD		24	24			
LOCKHEED MARTIN (call) -490- 15.12.23	USD		24	24			
LOCKHEED MARTIN (put) -480- 16.06.23	USD	-24	24				
LOCKHEED MARTIN (put) -500- 15.09.23	USD		24	24			
LOCKHEED MARTIN (put) -500- 16.06.23	USD		24	24			
MICROSOFT (call) -280- 16.06.23	USD		65	65			
MICROSOFT (call) -295- 19.05.23	USD	-65	65				
MICROSOFT (call) -300- 16.06.23	USD		65	65			
MICROSOFT (call) -310- 15.12.23	USD			50	-50	-100'400.00	-0.45
MICROSOFT (call) -310- 21.07.23	USD		65	65			
MICROSOFT (call) -315- 18.08.23	USD		65	65			
MICROSOFT (call) -315- 20.10.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -320- 15.12.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -325- 18.08.23	USD		65	65			
MICROSOFT (call) -330- 15.12.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -330- 18.08.23	USD		50	50			

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
MICROSOFT (call) -330- 20.10.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -340- 15.12.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -340- 18.08.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -345- 15.09.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -350- 18.08.23	USD		100	100			
MICROSOFT (call) -350- 21.07.23	USD		50	50			
MICROSOFT (call) -370- 15.09.23	USD		50	50			
MICROSTRATEGY a (put) -330- 19.05.23	USD	-9	9				
MICROSTRATEGY a (put) -340- 19.05.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -340- 21.04.23	USD	-9	9				
MICROSTRATEGY a (put) -350- 16.06.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -350- 21.07.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -360- 16.06.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -360- 19.05.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -370- 19.05.23	USD		9	9			
MICROSTRATEGY a (put) -380- 21.07.23	USD		18	18			
MICROSTRATEGY a (put) -400- 15.12.23	USD			9	-9	-75'600.00	-0.34
MICROSTRATEGY a (put) -420- 15.12.23	USD			9	-9	-90'225.00	-0.40
MICROSTRATEGY a (put) -420- 18.08.23	USD		18	18			
MICROSTRATEGY a (put) -450- 15.09.23	USD		28	28			
MICROSTRATEGY a (put) -470- 18.08.23	USD		18	18			
NASDAQ 100 (call) -12400- 16.06.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -12400- 19.05.23	USD	-5	5				
NASDAQ 100 (call) -13400- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -13600- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14000- 20.10.23	USD			10	-10	-849'300.00	-3.79
NASDAQ 100 (call) -14100- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14300- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14300- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14500- 15.09.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14500- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14500- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14600- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14600- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14700- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14700- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14800- 15.09.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -14800- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -14900- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15000- 20.10.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15000- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (call) -15100- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15200- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15300- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15300- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15500- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (call) -15700- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -11000- 29.12.23	USD		10		10	25'900.00	0.12
NASDAQ 100 (put) -11700- 16.06.23	USD		30	30			
NASDAQ 100 (put) -11700- 19.05.23	USD	30		30			
NASDAQ 100 (put) -12500- 16.06.23	USD		25	25			
NASDAQ 100 (put) -13000- 16.06.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -13000- 19.05.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -13000- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -13200- 19.05.23	USD	-5	15	10			
NASDAQ 100 (put) -13300- 16.06.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -13500- 16.06.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -13500- 17.11.23	USD		15		15	116'475.00	0.52
NASDAQ 100 (put) -13600- 21.07.23	USD		30	30			
NASDAQ 100 (put) -13800- 21.07.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -14000- 20.10.23	USD		10		10	74'600.00	0.33
NASDAQ 100 (put) -14000- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14300- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14400- 18.08.23	USD		25	25			
NASDAQ 100 (put) -14500- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14500- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -14500- 20.10.23	USD		25	15	10	132'300.00	0.59
NASDAQ 100 (put) -14600- 21.07.23	USD		30	30			
NASDAQ 100 (put) -14800- 17.11.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -14800- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15000- 15.09.23	USD		15	15			

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
NASDAQ 100 (put) -15000- 17.11.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15000- 18.08.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15000- 20.10.23	USD			5	-5	-151'975.00	-0.68
NASDAQ 100 (put) -15000- 21.07.23	USD		30	30			
NASDAQ 100 (put) -15100- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15200- 17.11.23	USD			10	-10	-549'130.00	-2.45
NASDAQ 100 (put) -15300- 15.09.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15300- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15300- 20.10.23	USD		5	10	-5	-291'600.00	-1.30
NASDAQ 100 (put) -15300- 21.07.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15400- 15.09.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15400- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15500- 18.08.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15600- 20.10.23	USD		15	15			
NASDAQ 100 (put) -15600- 21.07.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15700- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15800- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -15800- 20.10.23	USD		20	20			
NASDAQ 100 (put) -15900- 15.09.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -15900- 20.10.23	USD		5	5			
NASDAQ 100 (put) -16000- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -16100- 18.08.23	USD		10	10			
NASDAQ 100 (put) -9500- 29.12.23	USD		10	10			
NORTHROP GRUMMAN (call) -430- 17.11.23	USD			24	-24	-55'200.00	-0.25
NORTHROP GRUMMAN (call) -450- 17.11.23	USD		24	24			
NORTHROP GRUMMAN (call) -450- 18.08.23	USD		24	24			
NORTHROP GRUMMAN (call) -480- 16.06.23	USD	-24	24	24			
NORTHROP GRUMMAN (call) -480- 17.11.23	USD		24	24			
NVIDIA (call) -430- 15.12.23	USD			5	-5	-21'075.00	-0.09
NVIDIA (call) -520- 15.12.23	USD		5	5			
NVIDIA (put) -520- 15.12.23	USD		5	5			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -14- 20.10.23	USD		500	500			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -15- 18.08.23	USD		750	750			
PETROLEO BRASILIENRO adr (call) -15- 20.10.23	USD			750	-750	-36'750.00	-0.16
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -11- 16.06.23	USD		200	200			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -11- 19.05.23	USD		400	400			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 16.06.23	USD		400	400			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 19.05.23	USD		400	400			
PETROLEO BRASILIENRO adr (put) -12- 21.07.23	USD		400	400			
QUALCOMM (put) -120- 17.11.23	USD		60	60			
QUALCOMM (put) -130- 18.08.23	USD		60	60			
QUALCOMM (put) -135- 15.09.23	USD		60	60			
S&P 500 (put) -3750- 21.04.23	USD	50		50			
S&P 500 (put) -3800- 16.06.23	USD		40	40			
S&P 500 (put) -3850- 19.05.23	USD		40	40			
S&P 500 (put) -3950- 21.07.23	USD		50	50			
S&P 500 (put) -4100- 16.06.23	USD		5	5			
S&P 500 (put) -4100- 21.07.23	USD		30	30			
S&P 500 (put) -4200- 16.06.23	USD		5	5			
S&P 500 (put) -4200- 18.08.23	USD		20	20			
S&P 500 (put) -4200- 20.10.23	USD		30	30	30	92'370.00	0.41
S&P 500 (put) -4200- 21.07.23	USD		20	20			
S&P 500 (put) -4250- 06.10.23	USD		25	25			
S&P 500 (put) -4280- 17.11.23	USD		15	15	15	123'285.00	0.55
S&P 500 (put) -4360- 20.10.23	USD		30	30			
S&P 500 (put) -4400- 20.10.23	USD		10	10			
S&P 500 (put) -4415- 15.09.23	USD		20	20			
S&P 500 (put) -4450- 18.08.23	USD		20	20			
TESLA MOTORS (call) -170- 19.05.23	USD		10	10			
TESLA MOTORS (call) -180- 21.04.23	USD	-10	10	10			
UNITED TECHNOLOGIES CORP (put) -110- 19.05.23	USD	-42	42				
VALERO ENERGY (call) -140- 15.12.23	USD			70	-70	-67'200.00	-0.30
VALERO ENERGY (call) -145- 15.09.23	USD		70	70			
VALERO ENERGY (call) -145- 19.05.23	USD	-70	70				
VALERO ENERGY (put) -110- 16.06.23	USD		30	30			
VALERO ENERGY (put) -115- 15.09.23	USD		30	30			
VALERO ENERGY (put) -115- 21.07.23	USD		30	30			
VALERO ENERGY (put) -125- 15.09.23	USD		30	30			
Total Options						-2'148'735.00	-9.59
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						-2'148'735.00	-9.59

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Total Derivative Finanzinstrumente						-2'148'735.00	-9.59
Total Anlagen						18'126'986.51	80.90
Bankguthaben auf Sicht						4'228'590.19	18.87
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						51'259.55	0.23
Gesamtfondsvermögen (GFV)						22'406'836.25	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						42'976.64	0.19
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettofondsvermögen						22'363'859.61	99.81

(1) Umfassen auch Corporate Actions

Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

Anlagekategorien	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	12'944'761.87	57.77
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	5'182'224.64	23.13
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

Ausserbilanzgeschäfte 1	30.09.2023		31.03.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	142'471'274.00	637.06%	81'665'822.00	331.23%
Total engagementerhöhende Positionen	142'471'274.00	637.06%	81'665'822.00	331.23%
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	142'471'274.00	637.06%	81'665'822.00	331.23%
Total engagementreduzierende Positionen	142'471'274.00	637.06%	81'665'822.00	331.23%

1 Die Berechnung des Basiswertäquivalent aus Optionen erfolgt mit einem Delta von 1 bzw. -1. Auf eine Verrechnung gegenläufiger Positionen wird verzichtet.

Erläuterungen zum Halbjahresbericht per 30. September 2023

Erläuterung 1: Angaben über Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

Am 19. März 2023 haben die Credit Suisse Group AG und die UBS Group AG eine Vereinbarung zum Zusammenschluss unterzeichnet, welche per 12. Juni 2023 vollzogen wurde. Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen mit konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG bzw. der UBS Group AG. Diese Beziehungen und Dienstleister können in Zukunft ändern.

Erläuterung 2: Verkaufsrestriktionen USA

Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen innerhalb der USA und ihren Territorien weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden. Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen Bürgern der USA oder Personen mit Wohnsitz oder Sitz in den USA und/oder anderen natürlichen wie juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Erträge, ungeachtet der Herkunft, der US-Einkommenssteuer unterliegen sowie Personen, die gemäss Bestimmung S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils gültigen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Erläuterung 3: Kennzahlen und technische Daten

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Währung	Depotbankkommission	Verwaltungs- ¹ kommission	Total Expense Ratio (TER) ²
AWMZ Fund I	F	2 257 172	USD	0.05%	1.85%	1.93%
AWMZ Fund II	F	2 563 237	USD	0.09%	1.85%	2.01%

¹ Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

² Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens. Allfällige Rückvergütungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER.

Erläuterung 4: Fondsp performance

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungsdatum	Währung	2022 ¹	2021 ¹	2019 ¹
AWMZ Fund I	F	2 257 172	13.01.2006	USD	-19.5%	3.8%	-18.4%
AWMZ Fund II	F	2 563 237	29.09.2006	USD	-20.7%	3.5%	-24.1%

¹ Die Fondsp performance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Börsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Erläuterung 5: Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften

Keine

Erläuterung 6: Entgegengenommene Sicherheiten

Keine

Erläuterung 7: Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihen

Keine

Erläuterung 8: Zusammensetzung des Portefeuilles

Die Zusammensetzung des Portefeuilles weist Bestandesveränderungen ohne Fraktionen aus. Dies kann zu Rundungsdifferenzen in der Totalisierung führen.

Erläuterung 9: Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte für Brutto/Netto Darstellung (Commitment-Ansatz II)

Es wird auf eine Verrechnung gegenläufiger Derivat-Positionen verzichtet. Somit entspricht das Netto-Gesamtengagement aus Derivaten dem Wert des Brutto-Gesamtengagements.

Erläuterung 10: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile

- Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
- An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
- Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.

4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite sukzessive dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die kleinste gängige Rechnungseinheit oder, falls abweichend, der Referenzwährung gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) bzw. der Erstausgabe einer weiteren Anteilklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird danach bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Nettoinventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Nettoinventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilklasse oder im Interesse mehrerer Anteilklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Credit Suisse Funds AG
Uetlibergstrasse 231
CH-8070 Zürich

www.credit-suisse.com