

# **DIVAS SK Enhanced Fund**

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

---

Halbjahresbericht per 30. September 2023

## Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
SK Enhanced Fund Equities	4
SK Enhanced Fund Fixed Income	13
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	23

## Verwaltung und Organe

### Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

### Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident
- Luca Diener, Vizepräsident
- Patrick Tschumper, Mitglied
- 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 Anlageentscheide der Teilvermögen sind an die DIVAS Asset Management AG, Zürich, übertragen.

Die DIVAS Asset Management AG verfügt über eine Bewilligung als Vermögensverwalter kollektiver Kapitalanlagen von der FINMA und untersteht deren Aufsicht.

Die genaue Ausführung des Auftrags regelt ein zwischen der Fondsleitung und der DIVAS Asset Management AG, Zürich, abgeschlossener Vermögensverwaltungsvertrag.

### 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
<b>Konsolidierung</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	134.01	138.90	155.88
<b>Anteilklasse A</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	0.00	0.00	0.00
Inventarwert pro Anteil	CHF	121.60	120.38	130.09
<b>Anteilklasse V1</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	134.01	138.90	155.88
Inventarwert pro Anteil	CHF	124.02	122.22	131.54
<b>Anteilklasse V2</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	-	-	0.00
Inventarwert pro Anteil	CHF	-	-	130.66

## Wechselkurse

<b>Wechselkurse per</b>	<b>30.09.2023</b>
ENGLISCHES PFUND	1.116613
EURO	0.968550
JAPANISCHER YEN	0.006130
KANADISCHER DOLLAR	0.676645
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.914805

## Vermögensrechnung per 30. September 2023

	Konsolidierung	
	30.09.2023	31.03.2023
	CHF	CHF
<b>Vermögenswerte</b>		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	1'188'409.09	1'168'898.16
Geldmarktinstrumente	2'521'634.69	4'194'188.84
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Strukturierte Produkte	13'215'184.65	12'993'708.69
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'070'803.54	1'762'756.01
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	116'038'519.85	118'636'668.23
Derivative Finanzinstrumente	-330'202.65	264'035.75
Sonstige Vermögenswerte	779'808.14	361'706.38
<b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>	<b>134'484'157.31</b>	<b>139'381'962.06</b>
Andere Verbindlichkeiten	477'170.01	480'255.84
<b>Nettofondsvermögen</b>	<b>134'006'987.30</b>	<b>138'901'706.22</b>
<b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	138'901'706.22	155'879'740.25
Ablieferung Verrechnungssteuer	-7.64	-9.92
Ausgaben von Anteilen	1'139'729.90	4'238'159.33
Rücknahmen von Anteilen	-8'088'110.55	-10'026'993.55
Sonstiges aus Anteilverkehr	102'619.65	-595'788.90
Gesamterfolg	1'951'049.72	-10'593'400.99
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>134'006'987.30</b>	<b>138'901'706.22</b>
<b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	1'136'520.000	1'185'067.000
Ausgegebene Anteile	9'127.000	35'408.000
Zurückgenommene Anteile	-65'140.000	-83'955.000
<b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1'080'507.000</b>	<b>1'136'520.000</b>
<b>Währung Anteilklasse</b>		
<b>Inventarwert pro Anteil</b>		

Anteilklasse A		Anteilklasse V1		Anteilklasse V2	
01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
1'685.26	1'300.85	138'900'020.83	155'877'132.25	0.00	1'306.55
-7.64	-4.95	0.00	0.00	0.00	-4.97
0.00	3'718.30	1'139'729.90	4'234'441.00	0.00	0.03
0.00	-3'161.30	-8'088'110.55	-10'022'604.25	0.00	-1'228.00
0.00	-38.69	102'619.65	-595'676.13	0.00	-73.61
24.82	-128.95	1'951'024.90	-10'593'272.04	0.00	0.00
<b>1'702.44</b>	<b>1'685.26</b>	<b>134'005'284.73</b>	<b>138'900'020.83</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
14.000	10.000	1'136'506.000	1'185'047.000	0.000	10.000
0.000	31.000	9'127.000	35'377.000	0.000	0.000
0.000	-27.000	-65'140.000	-83'918.000	0.000	-10.000
<b>14.000</b>	<b>14.000</b>	<b>1'080'493.000</b>	<b>1'136'506.000</b>	<b>0.000</b>	<b>0.000</b>
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
<b>121.60</b>	<b>120.38</b>	<b>124.02</b>	<b>122.22</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

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

	Konsolidierung	
	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
	CHF	CHF
<b>Ertrag</b>		
Erträge der Bankguthaben	17'711.39	27'688.49
Negativzinsen	0.00	-55'674.09
Erträge der Geldmarktinstrumenten	52'306.57	35'946.58
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien	45'017.80	23'562.42
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'178'244.25	2'102'529.63
Sonstige Erträge	0.00	6'345.11
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	6'327.38	1'490.48
<b>Total Erträge</b>	<b>1'299'607.39</b>	<b>2'141'888.62</b>
<b>Aufwendungen</b>		
Passivzinsen	827.45	2'882.55
Prüfaufwand	7'475.21	14'512.49
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	987'565.72	2'003'151.28
- die Depotbank	6'177.11	6'567.20
Sonstige Aufwendungen	12'036.33	39'265.56
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	18'832.32	-12'847.02
<b>Total Aufwendungen</b>	<b>1'032'914.14</b>	<b>2'053'532.06</b>
<b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>	<b>266'693.25</b>	<b>88'356.56</b>
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds	0.00	2'014'164.80
<b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>	<b>266'693.25</b>	<b>2'102'521.36</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-430'011.32	-2'600'201.00
Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds	0.00	-2'014'164.80
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>-163'318.07</b>	<b>-2'511'844.44</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2'114'367.79	-8'081'556.55
<b>Gesamterfolg</b>	<b>1'951'049.72</b>	<b>-10'593'400.99</b>

Anteilklasse A		Anteilklasse V1		Anteilklasse V2	
01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
0.11	0.12	17'711.28	27'688.26	0.00	0.11
0.00	-0.35	0.00	-55'673.26	0.00	-0.48
0.47	0.52	52'306.10	35'945.84	0.00	0.22
0.56	0.28	45'017.24	23'562.11	0.00	0.03
14.67	21.82	1'178'229.58	2'102'499.54	0.00	8.27
0.00	0.05	0.00	6'345.01	0.00	0.05
0.00	-1.28	6'327.38	1'491.76	0.00	0.00
<b>15.81</b>	<b>21.16</b>	<b>1'299'591.58</b>	<b>2'141'859.26</b>	<b>0.00</b>	<b>8.20</b>
0.00	0.02	827.45	2'882.51	0.00	0.02
0.01	0.01	7'475.20	14'512.48	0.00	0.00
12.21	25.66	987'553.51	2'003'112.33	0.00	13.29
-0.03	-0.11	6'177.14	6'567.37	0.00	-0.06
0.14	0.57	12'036.19	39'264.76	0.00	0.23
0.00	-6.34	18'832.32	-12'835.40	0.00	-5.28
<b>12.33</b>	<b>19.81</b>	<b>1'032'901.81</b>	<b>2'053'504.05</b>	<b>0.00</b>	<b>8.20</b>
<b>3.48</b>	<b>1.35</b>	<b>266'689.77</b>	<b>88'355.21</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
0.00	20.47	0.00	2'014'144.33	0.00	0.00
<b>3.48</b>	<b>21.82</b>	<b>266'689.77</b>	<b>2'102'499.54</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
-5.53	-31.69	-430'005.79	-2'600'169.31	0.00	0.00
0.00	-20.47	0.00	-2'014'144.33	0.00	0.00
<b>-2.05</b>	<b>-30.34</b>	<b>-163'316.02</b>	<b>-2'511'814.10</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
26.87	-98.61	2'114'340.92	-8'081'457.94	0.00	0.00
<b>24.82</b>	<b>-128.95</b>	<b>1'951'024.90</b>	<b>-10'593'272.04</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

## Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>							
<b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>							
<b>Banken und andere Kreditinstitute</b>							
SOCIETE GENERALE PARIS -A-	EUR	14'000			14'000	312'483.29	0.23
						<b>312'483.29</b>	<b>0.23</b>
<b>Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie</b>							
ARCELORMITTAL	EUR	16'000			16'000	368'436.42	0.27
						<b>368'436.42</b>	<b>0.27</b>
<b>Biotechnologie</b>							
MODERNA INC	USD	800		800		0.00	0.00
						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Chemie</b>							
LANXESS	EUR	8'500			8'500	197'995.83	0.15
						<b>197'995.83</b>	<b>0.15</b>
<b>Elektrische Geräte und Komponenten</b>							
NEMETSCHEK	EUR	1'300		1'300		0.00	0.00
						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Elektronik und Halbleiter</b>							
ROYAL PHILIPS	EUR	10'000	446		10'446	191'888.00	0.14
						<b>191'888.00</b>	<b>0.14</b>
<b>Fahrzeuge</b>							
MERCEDES-BENZ GROUP AG	EUR	5'000		5'000		0.00	0.00
						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>						<b>1'070'803.54</b>	<b>0.80</b>
<b>Kollektive Kapitalanlagen</b>							
<b>Anlagefonds</b>							
CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (IE) MSCI USA BLUE UCITS ETF -B- USD	USD	185'700		9'700	176'000	26'804'231.31	19.93
ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	USD	70'000			70'000	274'408.63	0.20
						<b>27'078'639.94</b>	<b>20.14</b>
<b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>						<b>27'078'639.94</b>	<b>20.14</b>
<b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>						<b>28'149'443.48</b>	<b>20.93</b>
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>							
<b>Kollektive Kapitalanlagen</b>							
<b>Anlagefonds</b>							
BERENBERG EUROPEAN MICRO CAP FCP -I EUR- EUR	EUR	20'000			20'000	2'507'769.66	1.86
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY CANADA -ZA-	CAD	2'200			2'200	2'249'988.88	1.67
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY EMERGING MARKETS BLUE -DA-	CHF	1'100			1'100	1'865'193.00	1.39
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY EUROPE EX EMU EX CH - ZA-	CHF	3'620			3'620	2'383'625.20	1.77
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY JAPAN -ZAH- CHF	CHF	4'000			4'000	7'008'880.00	5.21
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY PACIFIC EX JAPAN BLUE -ZA-	CHF	3'470			3'470	2'539'935.90	1.89
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND LARGO CAP BLUE -ZA-	CHF	330			330	509'708.10	0.38
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND SMALL & MID CAP -ZA-	CHF	1'900			1'900	4'254'556.00	3.16
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND TOTAL MARKET BLUE -ZA-	CHF	4'220			4'220	6'197'027.80	4.61
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY US BLUE -ZA-	USD	2'400		550	1'850	4'892'106.03	3.64
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY WORLD EX CH -ZAH-	CHF	5'750			5'750	9'108'460.00	6.77
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) I - CSIF (CH) I EQUITY WORLD EX CH BLUE - ZAH-	CHF	8'700			8'700	14'883'873.00	11.07
CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -DB- USD	USD	1'100			1'100	943'332.48	0.70
DIVAS GLOBAL BARRIER COUPON FUND -I CHF DIST HEDGED- CHF	CHF	12'000		12'000			
PMG INDIVIDUAL FUND SOLUTIONS - GLOBAL LONG TERM WINNERS EQUITY FUND -A CHF ACC- CHF	CHF	11'040			11'040	937'406.40	0.70
QUANTEX FUNDS - QUANTEX GLOBAL VALUE FUND -CHF I- CHF	CHF	3'000		200	2'800	1'156'624.00	0.86
W&P SELECTION FUNDS SICAV -C CHF ACC- CHF	CHF	8'000			8'000	1'387'280.00	1.03
WHITE FLEET IV SICAV - DIVAS EUROZONE VALUE -IR EUR ACC- EUR	EUR	120'000			120'000	20'218'674.96	15.03

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens	
WHITE FLEET IV SICAV - EVOLT DYNAMIC BETA FUND -RR EUR ACC- EUR	EUR	80'000		16'000	64'000	5'915'438.50	4.40	
<b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>						<b>88'959'879.91</b>	<b>66.15</b>	
<b>Geldmarktinstrumente</b>							<b>88'959'879.91</b>	<b>66.15</b>
<b>Länder und Zentralregierungen</b>								
GERMAN TREASURY BILL 0%/22-13.04.2023	EUR	2'000'000		2'000'000				
GERMAN TREASURY BILL 0%/22-17.05.2023	EUR	500'000		500'000				
GERMAN TREASURY BILL 0%/23-15.05.2024	EUR		650'000		650'000	617'552.70	0.46	
GERMAN TREASURY BILL 0%/23-17.04.2024	EUR		2'000'000		2'000'000	1'904'081.99	1.42	
WI TREASURY BILL 0%/22-13.07.2023	USD	1'900'000		1'900'000				
						<b>2'521'634.69</b>	<b>1.88</b>	
<b>Total Geldmarktinstrumente</b>						<b>2'521'634.69</b>	<b>1.88</b>	
<b>Strukturierte Produkte</b>								
<b>Banken und andere Kreditinstitute</b>								
BNP PARIBAS ISSUANCE BV 0%/22-27.12.2024	USD	5'900'000		200'000	5'700'000	4'718'501.16	3.51	
UBS AG LONDON/22-12.01.2029	USD	70'000			70'000	6'080'893.09	4.52	
						<b>10'799'394.25</b>	<b>8.03</b>	
<b>Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen</b>								
VONTOBEL DIFC DUBAI/17-PERPETUAL	CHF	3'140			3'140	2'415'790.40	1.80	
						<b>2'415'790.40</b>	<b>1.80</b>	
<b>Total Strukturierte Produkte</b>						<b>13'215'184.65</b>	<b>9.83</b>	
<b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>						<b>104'696'699.25</b>	<b>77.85</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>								
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>								
<b>Financial Futures</b>								
<b>Aktienindex-Futures</b>								
EURO STOXX 50 Index -10- 06/23	EUR	57	57	114				
EURO STOXX 50 Index -10- 09/23	EUR		56	56				
EURO STOXX 50 Index -10- 12/23	EUR		56		56	0.00	0.00	
						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Total Financial Futures</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>								
<b>Devisentermingeschäfte</b>								
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-330'202.65	-0.25	
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>						<b>-330'202.65</b>	<b>-0.25</b>	
<b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>						<b>-330'202.65</b>	<b>-0.25</b>	
<b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>						<b>-330'202.65</b>	<b>-0.25</b>	
<b>Total Anlagen</b>						<b>132'515'940.08</b>	<b>98.54</b>	
Bankguthaben auf Sicht						1'188'409.09	0.88	
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00	
Sonstige Vermögenswerte						779'808.14	0.58	
<b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>						<b>134'484'157.31</b>	<b>100.00</b>	
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00	
./. Andere Verbindlichkeiten						477'170.01	0.35	
./. Andere Kredite						0.00	0.00	
<b>Nettofondsvermögen</b>						<b>134'006'987.30</b>	<b>99.65</b>	

(1) Umfassen auch Corporate Actions

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

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>	<b>28'149'443.48</b>	<b>20.93</b>
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>	<b>104'366'496.60</b>	<b>77.61</b>
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
23.06.2023	Bought	CHF	16'734'086	EUR	17'000'000	0.00	0.00
23.06.2023	Bought	CHF	24'772'797	USD	27'000'000	0.00	0.00
23.06.2023	Bought	EUR	530'000	CHF	521'758	0.00	0.00
23.06.2023	Bought	USD	1'663'000	CHF	1'492'599	0.00	0.00
25.09.2023	Bought	CHF	16'089'266	EUR	16'500'000	0.00	0.00
25.09.2023	Bought	CHF	22'573'437	USD	25'400'000	0.00	0.00
15.12.2023	Bought	CHF	15'344'848	EUR	16'000'000	-76'710.30	-0.06
15.12.2023	Bought	CHF	22'786'467	USD	25'400'000	-253'492.35	-0.19
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>						<b>-330'202.65</b>	<b>-0.25</b>

Ausserbilanzgeschäfte	30.09.2023		31.03.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	2'264'285.49	1.69%	2'441'131.66	1.76%
- Währungsrisiko	38'732'851.83	28.90%	41'537'693.90	29.90%
<b>Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten</b>	<b>40'997'137.32</b>	<b>30.59%</b>	<b>43'978'825.56</b>	<b>31.66%</b>
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	2'264'285.49	1.69%	2'441'131.66	1.76%
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
<b>Netto-Gesamtingagement aus Derivaten</b>	<b>2'264'285.49</b>	<b>1.69%</b>	<b>2'441'131.66</b>	<b>1.76%</b>

## Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	30.09.2023	31.03.2023	31.03.2022
<b>Konsolidierung</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	74.34	75.35	84.45
<b>Anteilklasse A</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	0.00	0.00	0.00
Inventarwert pro Anteil	CHF	81.90	83.17	90.35
<b>Anteilklasse V1</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	74.34	75.34	84.45
Inventarwert pro Anteil	CHF	83.82	84.97	91.92
<b>Anteilklasse V2</b>				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	-	-	0.00
Inventarwert pro Anteil	CHF	-	-	90.35

## 14 SK Enhanced Fund Fixed Income

Halbjahresbericht per 30. September 2023

### Wechselkurse

<b>Wechselkurse per</b>	<b>30.09.2023</b>
ENGLISCHES PFUND	1.116613
EURO	0.968550
KANADISCHER DOLLAR	0.676645
SCHWEDISCHE KRONE	0.084203
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.914805

## Vermögensrechnung per 30. September 2023

	Konsolidierung	
	30.09.2023	31.03.2023
	CHF	CHF
<b>Vermögenswerte</b>		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	1'542'522.43	646'859.99
Geldmarktinstrumente	1'822'018.21	1'778'886.20
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	26'825'169.08	26'461'063.89
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	43'766'954.91	45'783'006.57
Derivative Finanzinstrumente	-87'871.16	89'921.37
Sonstige Vermögenswerte	705'998.74	831'398.56
<b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>	<b>74'574'792.21</b>	<b>75'591'136.58</b>
Andere Verbindlichkeiten	236'710.54	243'855.95
<b>Nettofondsvermögen</b>	<b>74'338'081.67</b>	<b>75'347'280.63</b>
<hr/>		
	Konsolidierung	
	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
	CHF	CHF
<b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	75'347'280.63	84'453'427.99
Ablieferung Verrechnungssteuer	-5.96	-8.41
Ausgaben von Anteilen	2'810'376.35	1'864'651.78
Rücknahmen von Anteilen	-2'793'614.00	-4'618'914.30
Sonstiges aus Anteilverkehr	-9'407.53	-187'553.37
Gesamterfolg	-1'016'547.82	-6'164'323.06
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>74'338'081.67</b>	<b>75'347'280.63</b>
<hr/>		
<b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	886'772.000	918'775.000
Ausgegebene Anteile	32'988.000	21'522.000
Zurückgenommene Anteile	-32'903.000	-53'525.000
<b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>886'857.000</b>	<b>886'772.000</b>
<hr/>		
<b>Währung Anteilklasse</b>		
<b>Inventarwert pro Anteil</b>		

16 SK Enhanced Fund Fixed Income

Halbjahresbericht per 30. September 2023

Anteilklasse A		Anteilklasse V1		Anteilklasse V2	
01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
2'744.46	903.53	75'344'536.95	84'451'620.72	0.00	903.47
-5.96	-4.20	0.00	0.00	0.00	-4.21
0.00	3'912.80	2'810'376.35	1'860'738.95	0.00	0.03
0.00	-1'941.70	-2'793'614.00	-4'616'128.50	0.00	-844.10
0.00	97.93	-9'407.53	-187'595.06	0.00	-55.19
-35.92	-223.90	-1'016'511.90	-6'164'099.16	0.00	0.00
<b>2'702.58</b>	<b>2'744.46</b>	<b>74'335'379.87</b>	<b>75'344'536.95</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
33.000	10.000	886'739.000	918'755.000	0.000	10.000
0.000	46.000	32'988.000	21'476.000	0.000	0.000
0.000	-23.000	-32'903.000	-53'492.000	0.000	-10.000
<b>33.000</b>	<b>33.000</b>	<b>886'824.000</b>	<b>886'739.000</b>	<b>0.000</b>	<b>0.000</b>
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
<b>81.90</b>	<b>83.17</b>	<b>83.82</b>	<b>84.97</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

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

	Konsolidierung	
	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
	CHF	CHF
<b>Ertrag</b>		
Erträge der Bankguthaben	17'027.64	6'895.33
Negativzinsen	0.00	-37'364.58
Erträge der Geldmarktinstrumenten	40'682.96	30'325.86
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	215'877.64	319'140.60
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	624'793.95	1'026'859.32
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	6'597.86	7'689.26
<b>Total Erträge</b>	<b>904'980.05</b>	<b>1'353'545.79</b>
<b>Aufwendungen</b>		
Passivzinsen	41.30	241.33
Prüfaufwand	7'475.21	14'512.49
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	496'146.57	1'031'913.86
- die Depotbank	3'171.12	3'645.30
Sonstige Aufwendungen	9'131.79	23'830.53
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	9'082.27	16'561.58
<b>Total Aufwendungen</b>	<b>525'048.26</b>	<b>1'090'705.09</b>
<b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>	<b>379'931.79</b>	<b>262'840.70</b>
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds	0.00	755'129.88
<b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>	<b>379'931.79</b>	<b>1'017'970.58</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-410'190.72	-590'902.43
Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds	0.00	-755'129.88
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>-30'258.93</b>	<b>-328'061.73</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-986'288.89	-5'836'261.33
<b>Gesamterfolg</b>	<b>-1'016'547.82</b>	<b>-6'164'323.06</b>

18 SK Enhanced Fund Fixed Income

Halbjahresbericht per 30. September 2023

Anteilklasse A		Anteilklasse V1		Anteilklasse V2	
01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023	01.04.2023 - 30.09.2023	01.04.2022 - 31.03.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
0.37	0.07	17'027.27	6'895.24	0.00	0.02
0.00	-0.85	0.00	-37'363.32	0.00	-0.41
1.49	1.11	40'681.47	30'324.64	0.00	0.11
8.04	8.51	215'869.60	319'129.23	0.00	2.86
22.61	17.02	624'771.34	1'026'833.94	0.00	8.36
0.00	19.33	6'597.86	7'669.93	0.00	0.00
<b>32.51</b>	<b>45.19</b>	<b>904'947.54</b>	<b>1'353'489.66</b>	<b>0.00</b>	<b>10.94</b>
0.00	0.00	41.30	241.33	0.00	0.00
0.05	0.03	7'475.16	14'512.45	0.00	0.01
17.16	25.31	496'129.41	1'031'880.70	0.00	7.85
-0.05	-0.16	3'171.17	3'645.51	0.00	-0.05
0.32	0.60	9'131.47	23'829.77	0.00	0.16
0.00	8.30	9'082.27	16'550.31	0.00	2.97
<b>17.48</b>	<b>34.08</b>	<b>525'030.78</b>	<b>1'090'660.07</b>	<b>0.00</b>	<b>10.94</b>
<b>15.03</b>	<b>11.11</b>	<b>379'916.76</b>	<b>262'829.59</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
0.00	5.91	0.00	755'123.97	0.00	0.00
<b>15.03</b>	<b>17.02</b>	<b>379'916.76</b>	<b>1'017'953.56</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
-14.95	-21.51	-410'175.77	-590'880.92	0.00	0.00
0.00	-5.91	0.00	-755'123.97	0.00	0.00
<b>0.08</b>	<b>-10.40</b>	<b>-30'259.01</b>	<b>-328'051.33</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
-36.00	-213.50	-986'252.89	-5'836'047.83	0.00	0.00
<b>-35.92</b>	<b>-223.90</b>	<b>-1'016'511.90</b>	<b>-6'164'099.16</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

## Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>							
<b>Anleihen</b>							
<b>Banken und andere Kreditinstitute</b>							
0.200	BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027	CHF	400'000		400'000	366'800.00	0.49
0.150	BNP PARIBAS 0.15%/20-10.03.2028	CHF	600'000		600'000	544'800.00	0.73
0.300	BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027	CHF	400'000		400'000	367'600.00	0.49
0.625	DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023	CHF	200'000		200'000	199'100.00	0.27
0.375	SOCIETE GENERALE 0.375%/21-26.07.2028	CHF	600'000		600'000	542'700.00	0.73
0.250	SOCIETE GENERALE SA 0.25%/19-08.10.2026	CHF	400'000		400'000	375'200.00	0.50
0.375	UBS GROUP AG 0.375%/21-24.08.2029	CHF	800'000		800'000	711'200.00	0.95
						<b>3'107'400.00</b>	<b>4.17</b>
<b>Baustoffe und Bauindustrie</b>							
0.750	GEBERIT AG 0.75%/22-29.09.2027	CHF	300'000		300'000	287'700.00	0.39
						<b>287'700.00</b>	<b>0.39</b>
<b>Chemie</b>							
0.150	GIVAUDAN AG 0.15%/20-10.11.2028	CHF	300'000		300'000	274'350.00	0.37
0.200	SIEGFRIED HOLDING LTD 0.2%/21-15.06.2026	CHF	800'000		800'000	762'800.00	1.02
						<b>1'037'150.00</b>	<b>1.39</b>
<b>Diverse Dienstleistungen</b>							
0.875	ADECCO GROUP INC. 0.875%/20-27.11.2025	CHF	600'000		600'000	584'400.00	0.78
						<b>584'400.00</b>	<b>0.78</b>
<b>Energie- und Wasserversorgung</b>							
2.000	KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG 2%/22-15.06.2027	CHF	300'000		300'000	294'600.00	0.40
0.125	KRAFTWERKE OBERHASLI 0.125%/21-21.02.2031	CHF	200'000		200'000	170'600.00	0.23
0.050	SWISSGRID LTD 0.05%/21-30.06.2033	CHF	500'000		500'000	404'500.00	0.54
						<b>869'700.00</b>	<b>1.17</b>
<b>Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen</b>							
0.850	DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 0.85%/18-14.11.2025	CHF	500'000		500'000	488'750.00	0.66
0.375	EMMI FINANZ AG 0.375%/21-01.12.2031	CHF	400'000		400'000	350'000.00	0.47
0.350	GLENCORE FINANCE (EUROPE) LIMITED 0.35%/19-10.09.2025	CHF	700'000		700'000	674'450.00	0.90
0.250	LAFARGEHOLCIM HELVETIA 0.25%/21-18.03.2027	CHF	630'000		630'000	595'035.00	0.80
0.150	PARTNERS GROUP HOLDING A 0.15%/17-07.06.2024	CHF	315'000		315'000	310'905.00	0.42
0.375	SHELL INTERNATIONAL FINANCE 0.375%/15-21.08.2023	CHF	400'000	400'000			
0.375	STADLER RAIL AG 0.375%/19-20.11.2026	CHF	320'000		320'000	304'000.00	0.41
1.250	SYNGENTA FINANCE AG 1.25%/20-16.10.2023	CHF	500'000		500'000	499'600.00	0.67
						<b>3'222'740.00</b>	<b>4.32</b>
<b>Gesundheits- und Sozialdienste</b>							
1.250	HIRSLANDEN AG 1.25%/21-25.02.2026	CHF	910'000		910'000	882'436.10	1.18
1.950	INSELSPITAL STFTNG BERN 1.95%/23-07.05.2026	CHF	700'000		700'000	696'150.00	0.93
0.125	INSELSPITAL-STIFTUNG 0.125%/21-01.01.2500	CHF	600'000		600'000	531'600.00	0.71
0.350	KANTONSSPITAL BADEN AG 0.35%/21-30.09.2036	CHF	600'000		600'000	461'400.00	0.62
						<b>2'571'586.10</b>	<b>3.45</b>
<b>Maschinenbau und Industrieanlagen</b>							
1.500	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING LTD 1.5%/20-30.09.2024	CHF	600'000		600'000	591'000.00	0.79
						<b>591'000.00</b>	<b>0.79</b>
<b>Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke</b>							
0.010	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG 0.01%/20-06.10.2028	CHF	1'000'000		1'000'000	910'000.00	1.22
						<b>910'000.00</b>	<b>1.22</b>
<b>Städte und Gemeinden</b>							
0.750	STADT ZUERICH 0.75%/22-25.04.2031	CHF	600'000		600'000	561'600.00	0.75
						<b>561'600.00</b>	<b>0.75</b>
<b>Versicherungsgesellschaften</b>							
-	ZURICH INSURANCE CO 0%/21-26.08.2031	CHF	390'000		390'000	332'280.00	0.45
						<b>332'280.00</b>	<b>0.45</b>
<b>Total Anleihen</b>						<b>14'075'556.10</b>	<b>18.87</b>
<b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b>						<b>14'075'556.10</b>	<b>18.87</b>
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>							
<b>Anleihen</b>							
<b>Banken und andere Kreditinstitute</b>							
1.000	ABN AMRO BANK NV 1%/21-02.06.2033	EUR	100'000		100'000	73'087.75	0.10
-	BANCO BPM SPA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-29.06.2031	EUR	100'000		100'000	86'135.09	0.12
-	DEUTSCHE BANK AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-19.05.2031	EUR	300'000		300'000	281'874.20	0.38
-	GOLDMAN SACHS GROUP INC FIX-TO-FRN FRN/21-12.02.2026	USD	250'000		250'000	211'905.48	0.28
-	ING GROEP NV FIX-TO-FRN FRN/21-01.02.2030	EUR	1'000'000		1'000'000	765'919.65	1.03
0.625	INTESA SANPAOLO SPA 0.625%/21-24.02.2026	EUR	250'000		250'000	220'986.79	0.30

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
1.900 MASTERCARD INC 1.9%/21-15.03.2031	USD	130'000			130'000	94'529.66	0.13
- UNICREDIT SPA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-15.01.2032	EUR	200'000			200'000	170'517.10	0.23
- UNICREDIT SPA FIX-TO-FRN FRN/19-03.07.2025	EUR	250'000			250'000	236'791.10	0.32
- UNICREDIT SPA FIX-TO-FRN FRN/20-22.07.2027	EUR	300'000			300'000	268'920.81	0.36
						<b>2'410'667.63</b>	<b>3.23</b>
<b>Bergbau-, Kohle- und Stahlindustrie</b>							
3.600 ARCELORMITTAL SA 3.6%/19-16.07.2024	USD	915'000			915'000	819'979.37	1.10
						<b>819'979.37</b>	<b>1.10</b>
<b>Biotechnologie</b>							
2.300 AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.3%/21-12.03.2031	USD	800'000			800'000	578'544.76	0.78
						<b>578'544.76</b>	<b>0.78</b>
<b>Chemie</b>							
0.101 BASF SE 0.101%/20-05.06.2023	EUR	100'000		100'000			
1.000 LANXESS (reg. shares) -S- 1%/16-07.10.2026	EUR	250'000			250'000	221'187.76	0.30
						<b>221'187.76</b>	<b>0.30</b>
<b>Computerhardware und Netzwerk</b>							
1.250 APPLE INC 1.25%/20-20.08.2030	USD	650'000			650'000	464'721.95	0.62
						<b>464'721.95</b>	<b>0.62</b>
<b>Diverse Dienstleistungen</b>							
- FORTACO GRP HOLDCO OYJ FRN/22-22.07.2027	EUR		500'000		500'000	456'453.40	0.61
- SKILL BIDCO APS FRN/23-02.03.2028	EUR	500'000			500'000	482'638.15	0.65
0.750 VISA INC 0.75%/20-15.08.2027	USD	250'000			250'000	195'246.87	0.26
						<b>1'134'338.42</b>	<b>1.52</b>
<b>Edelmetalle und Edelsteine</b>							
2.630 YAMANA GOLD INC 2.63%/22-15.08.2031	USD	270'000			270'000	189'350.68	0.25
						<b>189'350.68</b>	<b>0.25</b>
<b>Einzelhandel und Warenhäuser</b>							
1.650 AMAZON.COM INC 1.65%/21-12.05.2028	USD	500'000			500'000	393'503.45	0.53
						<b>393'503.45</b>	<b>0.53</b>
<b>Elektronik und Halbleiter</b>							
0.750 INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.75%/20-24.06.2023	EUR	100'000		100'000			
2.000 THERMO FISHER SCIENTIFIC 2%/21-15.10.2031	USD	600'000			600'000	425'055.09	0.57
						<b>425'055.09</b>	<b>0.57</b>
<b>Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen</b>							
0.800 AGCO INTERNATIONAL HOLDI 0.8%/21-06.10.2028	EUR	200'000			200'000	160'207.86	0.21
1.000 BLACKSTONE PP EUR HOLD 1%/21-04.05.2028	EUR	250'000			250'000	191'080.39	0.26
1.125 CONTI-GUMMI FINANCE B.V. 1.125%/20-25.09.2024	EUR	100'000			100'000	93'942.57	0.13
2.125 CONTI-GUMMI FINANCE B.V. 2.125%/20-27.11.2023	EUR	10'000			10'000	9'656.44	0.01
0.875 EQT AB 0.875%/21-14.05.2031	EUR	100'000			100'000	70'304.14	0.09
1.875 FEDEX 2020-1 CLASS AA S. -2020-1- 1.875%/20-20.02.2034	USD	150'000			150'000	92'614.65	0.12
- GAZPROM PJSC (GAZ FN) (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	100'000			100'000	58'581.78	0.08
2.500 VOLKSWAGEN FIN SERV AG 2.5%/20-06.04.2023	EUR	60'000		60'000			
- VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	100'000			100'000	91'404.00	0.12
0.750 WUERTH FINANCE INTL BV 0.75%/20-22.11.2027	EUR	100'000			100'000	85'877.45	0.12
3.000 ZF FINANCE GMBH 3%/20-21.09.2025	EUR	100'000			100'000	92'375.46	0.12
- ZITON AS FRN/23-09.06.2028	EUR		400'000		400'000	383'386.96	0.51
						<b>1'329'431.70</b>	<b>1.78</b>
<b>Gesundheits- und Sozialdienste</b>							
1.750 IQVIA INC 1.75%/21-15.03.2026	EUR	200'000			200'000	180'382.75	0.24
						<b>180'382.75</b>	<b>0.24</b>
<b>Grafikverlags- und Druckmedien</b>							
1.500 COMCAST CORP 1.5%/20-15.02.2031	USD	50'000			50'000	34'544.87	0.05
						<b>34'544.87</b>	<b>0.05</b>
<b>Internet, Software und IT-Dienstleistungen</b>							
1.100 ALPHABET INC 1.1%/20-15.08.2030	USD	600'000			600'000	426'729.18	0.57
- SAP SE 0%/20-17.05.2023	EUR	100'000		100'000			
1.750 TSMC GLOBAL LTD 1.75%/21-23.04.2028	USD	200'000			200'000	156'166.39	0.21
						<b>582'895.57</b>	<b>0.78</b>
<b>Länder und Zentralregierungen</b>							
0.400 CHINA GOVT INTL BOND 0.4%/20-21.10.2023	USD	200'000			200'000	182'496.32	0.24

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
- REPUBLIKA SLOVENIJA 0%/21-12.02.2031	EUR	260'000			260'000	193'248.97	0.26
						<b>375'745.29</b>	<b>0.50</b>
<b>Maschinenbau und Industrieanlagen</b>							
- VOSSLOH AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-PERPETUAL	EUR	100'000			100'000	91'757.52	0.12
						<b>91'757.52</b>	<b>0.12</b>
<b>Nichteisenmetalle</b>							
4.196 ERAMET 4.196%/17-28.02.2024	EUR	300'000		300'000			
5.875 ERAMET 5.875%/19-21.05.2025	EUR	100'000			100'000	96'187.67	0.13
						<b>96'187.67</b>	<b>0.13</b>
<b>Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte</b>							
- ADVISE GROUP AB FRN/23-26.05.2026	SEK		6'250'000		6'250'000	543'791.04	0.73
0.700 ASTRAZENECA PLC 0.7%/20-08.04.2026	USD	400'000			400'000	326'347.61	0.44
1.957 BECTON DICKINSON AND CO 1.957%/21-11.02.2031	USD	200'000			200'000	143'035.28	0.19
1.900 BOSTON SCIENTIFIC CORP 1.9%/20-01.06.2025	USD	15'000			15'000	12'899.99	0.02
0.950 JOHNSON & JOHNSON 0.95%/20-01.09.2027	USD	724'000			724'000	568'773.03	0.76
0.750 MERCK & CO INC 0.75%/20-24.02.2026	USD	90'000			90'000	74'132.15	0.10
- MERCK KGAA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-09.09.2080	EUR	100'000			100'000	86'927.36	0.12
						<b>1'755'906.46</b>	<b>2.35</b>
<b>Telekommunikation</b>							
- TELEFONICA EUROPE BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-PERPETUAL	EUR	100'000			100'000	76'117.38	0.10
4.000 TIM S.P.A. 4%/19-11.04.2024	EUR	400'000			400'000	384'979.25	0.52
						<b>461'096.63</b>	<b>0.62</b>
<b>Textilien, Bekleidung und Lederwaren</b>							
- ADIDAS AG 0%/20-09.09.2024	EUR	300'000			300'000	279'895.45	0.38
						<b>279'895.45</b>	<b>0.38</b>
<b>Verkehr und Transport</b>							
- DEUTSCHE LUFTHANSA AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/15-12.08.2075	EUR	200'000			200'000	180'609.39	0.24
						<b>180'609.39</b>	<b>0.24</b>
<b>Versicherungsgesellschaften</b>							
- ALLIANZ SE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-08.07.2050	EUR	100'000			100'000	78'935.86	0.11
- AXA SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-07.10.2041	EUR	100'000			100'000	73'480.01	0.10
- HANNOVER RE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-30.06.2042	EUR	300'000			300'000	210'691.59	0.28
0.875 NN GROUP NV 0.875%/21-23.11.2031	EUR	500'000			500'000	380'703.11	0.51
						<b>743'810.57</b>	<b>1.00</b>
<b>Total Anleihen</b>						<b>12'749'612.98</b>	<b>17.10</b>
<b>Kollektive Kapitalanlagen</b>							
<b>Anlagefonds</b>							
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND AGGREGATE GBP -ZA-	GBP	1'000			1'000	1'028'902.93	1.38
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND AGGREGATE USD -ZA-	USD	4'002			4'002	3'886'497.87	5.21
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD BLUE -DAH-	CHF	2'000			2'000	1'359'080.00	1.82
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND INFLATION-LINKED GLOBAL EX JAPAN EX ITALY EX SPAIN BLUE -ZAH-	CHF	2'200			2'200	2'253'460.00	3.02
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND SWITZERLAND AAA-BBB BLUE -ZA-	CHF	5'100			5'100	5'127'540.00	6.88
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND SWITZERLAND CORPORATE BLUE -ZA- CHF	CHF	5'900			5'900	5'531'545.00	7.42
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) BOND SWITZERLAND FOREIGN AAA-BBB BLUE -ZA- CHF	CHF	3'640			3'640	3'308'978.40	4.44
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) I - CSIF (CH) I BOND AGGREG GLOBAL EX CH CHF -ZAH-	CHF	15'000			15'000	12'061'350.00	16.17
CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) UMBRELLA - CSIF (CH) BOND CORPORATE EUR INDEX -ZAH- CHF	CHF	2'250			2'250	1'996'830.00	2.68
CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - BOND AGGREGATE EUR -DB- CHF	EUR	1'500		1'500			
CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - BOND AGGREGATE EUR -DB- CHF	CHF		1'500		1'500	1'177'380.00	1.58
CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - GOVERNMENT BONDS EUR BLUE -DB- CHF	CHF	250			250	205'205.00	0.28
CREDIT SUISSE L/S SWISS FRANC BOND FUND -IB- CHF	CHF	27'521			27'521	2'921'605.00	3.92
CSIF (CH) BOND CORP USD IDX BLUE ZAH -CHF-	CHF	2'850			2'850	2'317'848.00	3.11
CSIMF MONEY MARKET CHF -ZB-	CHF	1'300		1'300			
LAZARD CONVERTIBLE GLOBAL SICAV -I USD- USD	USD	350			350	461'913.50	0.62

Titelbezeichnung	Währung	31.03.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
UBS (LUX) BOND SICAV - CHINA FIXED INCOME (RMB) -USD Q ACC- USD	USD	1'300			1'300	128'819.21	0.17
						<b>43'766'954.91</b>	<b>58.69</b>
<b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>						<b>43'766'954.91</b>	<b>58.69</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>							
<b>Länder und Zentralregierungen</b>							
WI TREASURY BILL 0%/22-02.11.2023	USD	2'000'000			2'000'000	1'822'018.21	2.44
						<b>1'822'018.21</b>	<b>2.44</b>
<b>Total Geldmarktinstrumente</b>						<b>1'822'018.21</b>	<b>2.44</b>
<b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>						<b>58'338'586.10</b>	<b>78.23</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							
<b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>							
<b>Devisentermingeschäfte</b>							
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-87'871.16	-0.12
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>						<b>-87'871.16</b>	<b>-0.12</b>
<b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>						<b>-87'871.16</b>	<b>-0.12</b>
<b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>						<b>-87'871.16</b>	<b>-0.12</b>
<b>Total Anlagen</b>						<b>72'326'271.04</b>	<b>96.98</b>
Bankguthaben auf Sicht						1'542'522.43	2.07
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						705'998.74	0.95
<b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>						<b>74'574'792.21</b>	<b>100.00</b>
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						236'710.54	0.32
./. Andere Kredite						0.00	0.00
<b>Nettofondsvermögen</b>						<b>74'338'081.67</b>	<b>99.68</b>

(1) Umfassen auch Corporate Actions

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

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	14'075'556.10	18.87
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	58'250'714.94	78.11
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
23.06.2023	Bought	CHF	5'907'876	EUR	6'000'000	0.00	0.00
23.06.2023	Bought	CHF	8'213'827	USD	8'950'000	0.00	0.00
25.09.2023	Bought	CHF	6'825'812	EUR	7'000'000	0.00	0.00
25.09.2023	Bought	CHF	7'955'020	USD	8'950'000	0.00	0.00
15.12.2023	Bought	CHF	6'536'119	EUR	6'800'000	-17'971.69	-0.02
15.12.2023	Bought	CHF	8'002'996	USD	8'900'000	-69'899.47	-0.09
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>						<b>-87'871.16</b>	<b>-0.12</b>

Ausserbilanzgeschäfte	30.09.2023		31.03.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Währungsrisiko	14'727'906.19	19.81%	14'131'055.02	18.75%
<b>Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten</b>	<b>14'727'906.19</b>	<b>19.81%</b>	<b>14'131'055.02</b>	<b>18.75%</b>
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
<b>Netto-Gesamtingagement aus Derivaten</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>

## 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

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen der Teilvermögen im Ausland kommen die dort geltenden anlagefonds- und steuerrechtlichen Bestimmungen zur Anwendung.

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- <sup>1</sup> kommission	Total Expense Ratio (TER) <sup>2,3</sup>
SK Enhanced Fund Equities	A	38 036 241	CHF	-0.01%	1.43%	1.60%
	V1	38 036 253	CHF	0.00%	1.44%	1.64%
SK Enhanced Fund Fixed Income	A	38 036 255	CHF	-0.01%	1.28%	1.35%
	V1	38 036 267	CHF	0.00%	1.33%	1.43%

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

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Zusammengesetzte TER, da mehr als 10% des Nettovermögens in andere kollektive Kapitalanlagen (Zielfonds) per Stichtag investiert war. Die TER der Zielfonds können auch von KIID's, etc. stammen. Die maximale Verwaltungskommission der Zielfonds beträgt 3%.

### Erläuterung 4: Fondspersformance

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungsdatum	Währung	2022 <sup>1</sup>	2021 <sup>1</sup>	2020 <sup>1</sup>
SK Enhanced Fund Equities	A	38 036 241	11.10.2017	CHF	-15.8%	19.3%	6.0%
	V1	38 036 253	11.10.2017	CHF	-15.9%	19.2%	5.9%
SK Enhanced Fund Fixed Income	A	38 036 255	11.10.2017	CHF	-13.4%	-2.3%	1.1%
	V1	38 036 267	11.10.2017	CHF	-13.5%	-2.5%	1.1%

<sup>1</sup> Die Fondspersformance 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

Fondsname	Vertragspartner
SK Enhanced Fund Equities	CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG
SK Enhanced Fund Fixed Income	CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG

### 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: Unterjährig lancierte Teilvermögen oder Anteilklassen – Darstellung von Vergleichsangaben**

Angaben der Vermögens- und Erfolgsrechnung von Teilvermögen oder Anteilklassen, welche während der laufenden Berichtsperiode lanciert wurden, werden in der Vorperiode mit Nullwerten ausgewiesen.

Die folgenden Anteilklassen wurden aktiviert bzw. aufgrund von Rücknahmen des gesamten Umlaufbestandes deaktiviert.

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungsdatum	Schlussdatum
SK Enhanced Fund Equities	V2	38 036 254		01.02.2023
SK Enhanced Fund Fixed Income	V2	38 036 271		01.02.2023

**Erläuterung 11: 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.
- 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.
- 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.
- 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.
- 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird danach bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - 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;
  - 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 Kommissionsätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - 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](http://www.credit-suisse.com)