

SWISSCANTO (CH) MONEY MARKET FUND RESPONSIBLE OPPORTUNITIES CHF

Halbjahresbericht per 31.03.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Investment Fund II
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	42724208	CHF
FT CHF	122049506	CHF
MT CHF	52221057	CHF
NT CHF	39462806	CHF
VT CHF	130534016	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	13
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
8	Pauschale Verwaltungskommission	14
9	Benchmark	14
10	TER	14
11	Fussnoten	15
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'316'011'659.23	926'180'015.85	187'451'341.18	212'560'532.52
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'864.050	-	-	-
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		742'920'529.56	461'917'717.41	108'761'703.97	136'007'385.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'222'061.601	5'146'410.550	1'220'257.961	1'504'402.975
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.3570	89.7553	89.1301	90.4062
Thesaurierung je Anteil		-	0.64	1.00	1.33
Total Expense Ratio (TER)		0.10 %	0.09 %	0.08 %	0.08 %
Klasse FT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		118'866'878.08	69'576'649.81		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'168'191.030	688'396.179		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.7529	101.0707		
Thesaurierung je Anteil		-	0.67		
Total Expense Ratio (TER)		0.13 %	0.11 %		
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode					9'885.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode					100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)					98.8568
Thesaurierung je Anteil					1.53
Total Expense Ratio (TER)					-
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		440'360'787.92	394'685'648.63	78'689'637.21	76'543'261.65
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'561'836.375	4'117'129.649	827'070.846	793'567.501
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.5315	95.8643	95.1426	96.4546
Thesaurierung je Anteil		-	0.76	1.15	1.50
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse VT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'863'463.67			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		138'131.254			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.3644			
Total Expense Ratio (TER)		0.25 %			

Die in diesem Bericht enthaltenen Zahlen und Angaben sind vergangenheitsbezogen. Diese dürfen nicht als Garantie für die zukünftige Entwicklung verstanden werden.

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	0.92 %	1.41 %	-0.56 %	-0.67 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	0.91 %	1.38 %	0.12 %	-
Klasse MT CHF (Schliessung 11.07.2022)	-	-	-	-0.59 %
Klasse NT CHF	0.98 %	1.50 %	-0.48 %	-0.59 %
Klasse VT CHF (Lancierung 23.01.2024)	0.36 %	-	-	-
Benchmark	0.80 %	1.34 %	-0.41 %	-0.82 %
Tracking Error 33)	-	0.14 %	0.22 %	0.08 %

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 Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	0.12 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	0.11 %
Klasse NT CHF	0.18 %
Klasse VT CHF (Lancierung 23.01.2024)	-0.44 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.03.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	3'608'878.26	50'168'149.90
Geldmarktinstrumente	19'866'794.79	0.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'287'485'058.84	872'565'225.87
Derivative Finanzinstrumente	-598'201.24	-528'503.02
Sonstige Vermögenswerte	5'723'241.91	4'033'060.32
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'316'085'772.56	926'237'933.07
Andere Verbindlichkeiten	-74'113.33	-57'917.22
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'316'011'659.23	926'180'015.85

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'146'410.550	1'220'257.961
Ausgegebene Anteile		4'918'115.694	5'735'857.569
Zurückgenommene Anteile		-1'842'464.643	-1'809'704.980
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'222'061.601	5'146'410.550

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse FT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		688'396.179	-
Ausgegebene Anteile		742'130.669	1'147'278.323
Zurückgenommene Anteile		-262'335.818	-458'882.144
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'168'191.030	688'396.179

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'117'129.649	827'070.846
Ausgegebene Anteile		3'205'436.212	5'138'873.300
Zurückgenommene Anteile		-2'760'729.486	-1'848'814.497
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'561'836.375	4'117'129.649

	von bis	Lancierung 23.01.2024 31.03.2024
Klasse VT CHF		
Ausgegebene Anteile		172'213.796
Zurückgenommene Anteile		-34'082.542
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		138'131.254

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		926'180'015.85	187'451'341.18
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'756'704.83	-1'101'036.14
Saldo aus dem Anteilverkehr		381'838'910.04	729'699'254.86
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		10'749'438.17	10'130'455.95
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'316'011'659.23	926'180'015.85

Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		101'818.63	72'786.06
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-75.48	-170.95
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'865'819.95	4'065'631.00
Erträge aus Wertpapierleihe		17'235.10	23'461.45
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'532'116.19	4'920'826.09
Total Ertrag		5'516'914.39	9'082'533.65
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-384'072.77	-281'712.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-642'661.10	-1'849'408.45
Total Aufwand		-1'026'733.87	-2'131'120.63
Nettoertrag / Verlust		4'490'180.52	6'951'413.02
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'644'810.70	-679'845.74
Realisierter Erfolg		8'134'991.22	6'271'567.28
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'614'446.95	3'858'888.67
Gesamterfolg		10'749'438.17	10'130'455.95

Inventar des Fondsvermögens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveränderungen während der Periode

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'287'485'058.84	97.83	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'287'485'058.84	97.83	
AU3CB0213205	4.7500 % AFDB 4 3/4 03/06/24 GDIF	4'000	0	4'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0259943	3.0000 % CBAAU 3 01/11/24 MTN	5'500	0	5'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0267052	1.7500 % DE 1 3/4 10/04/24 MTN	0	8'810	0	8'810 AUD	98.55%	5'101'848.21	0.39	a)
AUD							5'101'848.21	0.39	
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	10'000	0	10'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FNR69	2.4960 % TD 2.496 12/02/24	0	5'000	0	5'000 CAD	98.32%	3'271'872.22	0.25	a)
CAC04575AB92	1.2500 % ATH 1 1/4 04/09/24 MPLE	4'500	0	0	4'500 CAD	99.92%	2'992'696.82	0.23	a)
CAD							6'264'569.04	0.48	
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	0	5'000	0	5'000 CHF	101.21%	5'060'500.00	0.38	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	0	47'000	8'000	39'000 CHF	99.96%	38'984'400.00	2.96	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	0	1'770	0	1'770 CHF	100.15%	1'772'655.00	0.13	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	0	16'370	0	16'370 CHF	100.14%	16'392'918.00	1.25	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	4'000	500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	14'450	2'620	17'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	6'765	4'000	0	10'765 CHF	99.92%	10'756'388.00	0.82	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'100	10'355	0	11'455 CHF	99.91%	11'444'690.50	0.87	a)
CH0188335365	1.7500 % SCMNXX 1 3/4 07/10/24	19'000	10'865	5'500	24'365 CHF	100.03%	24'372'309.50	1.85	a)
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	0	2'300	0	2'300 CHF	100.02%	2'300'460.00	0.17	a)
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	10'000	3'000	10'000	3'000 CHF	99.90%	2'997'000.00	0.23	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	0	1'020	0	1'020 CHF	99.74%	1'017'348.00	0.08	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	12'000	0	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	0	2'190	0	2'190 CHF	100.31%	2'196'789.00	0.17	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	13'890	1'500	15'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'230	1'000	3'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	0	6'440	0	6'440 CHF	100.16%	6'450'304.00	0.49	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	0	13'900	0	13'900 CHF	99.97%	13'895'830.00	1.06	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	0	12'385	0	12'385 CHF	100.13%	12'401'100.50	0.94	a)
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	21'100	3'090	24'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	5'900	0	5'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	5'190	0	5'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	12'830	5'000	17'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	0	5'500	0	5'500 CHF	100.29%	5'515'950.00	0.42	a)
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	6'625	0	6'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	6'000	0	6'000 CHF	99.93%	5'995'800.00	0.46	a)
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	100.03%	2'000'600.00	0.15	a)
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	4'650	1'500	0	6'150 CHF	99.93%	6'145'695.00	0.47	a)
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	5'740	1'980	0	7'720 CHF	99.94%	7'715'368.00	0.59	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	4'450	0	0	4'450 CHF	100.01%	4'450'445.00	0.34	a)
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	0	4'580	0	4'580 CHF	99.79%	4'570'382.00	0.35	a)
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	3'000	1'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	0	1'755	0	1'755 CHF	99.92%	1'753'596.00	0.13	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	3'000	12'310	0	15'310 CHF	99.76%	15'273'256.00	1.16	a)
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	0	4'545	0	4'545 CHF	99.63%	4'528'183.50	0.34	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	14'900	1'000	3'000	12'900 CHF	99.97%	12'896'130.00	0.98	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	0	5'390	0	5'390 CHF	99.75%	5'376'525.00	0.41	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	8'000	7'500	3'000	12'500 CHF	99.64%	12'455'000.00	0.95	a)
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	99.57%	2'987'100.00	0.23	a)
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	5'100	14'105	5'100	14'105 CHF	99.70%	14'062'685.00	1.07	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	0	2'205	0	2'205 CHF	99.44%	2'192'652.00	0.17	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	20'450	0	20'450 CHF	99.71%	20'390'695.00	1.55	a)
CH0262286252	0.6250 % WKBSNW 0 5/8 12/15/23	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	0	9'130	0	9'130 CHF	99.52%	9'086'176.00	0.69	a)
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	6'620	0	6'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	4'710	0	4'710 CHF	99.29%	4'676'559.00	0.36	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	0	30'680	0	30'680 CHF	99.24%	30'446'832.00	2.31	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	0	7'990	0	7'990 CHF	99.64%	7'961'236.00	0.60	a)
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	13'000	0	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	11'220	0	11'220 CHF	99.14%	11'123'508.00	0.85	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	0	1'580	0	1'580 CHF	98.99%	1'564'042.00	0.12	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	16'930	3'550	20'480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	13'270	0	13'270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	10'105	6'300	0	16'405 CHF	99.77%	16'367'268.50	1.24	a)
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	0	4'500	0	4'500 CHF	99.75%	4'488'750.00	0.34	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	12'910	0	12'910 CHF	99.26%	12'814'466.00	0.97	a)
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	0	1'235	0	1'235 CHF	99.15%	1'224'502.50	0.09	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	0	5'400	0	5'400 CHF	99.59%	5'377'860.00	0.41	a)
CH0302790115	0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN	8'200	0	8'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	7'300	0	7'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	16'160	0	16'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	25'320	0	25'320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	12'760	6'865	19'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	8'945	3'000	11'945	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	10'400	0	10'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0311427618	0.2000 % WKBSNW 0.2 08/19/24	0	4'610	0	4'610 CHF	99.48%	4'586'028.00	0.35	a)
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	1'185	4'915	0	6'100 CHF	99.35%	6'060'350.00	0.46	a)
CH0319415953	0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN	9'500	2'000	0	11'500 CHF	99.96%	11'495'400.00	0.87	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	0	5'250	0	5'250 CHF	99.80%	5'239'500.00	0.40	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	0	14'050	2'000	12'050 CHF	99.19%	11'952'395.00	0.91	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	10'000	16'660	3'000	23'660 CHF	99.70%	23'589'020.00	1.79	a)
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	1'695	0	1'695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	24'905	0	24'905 CHF	99.12%	24'685'836.00	1.88	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	11'950	8'895	0	20'845 CHF	99.55%	20'751'197.50	1.58	a)
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	5'000	600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	0	8'050	0	8'050 CHF	99.08%	7'975'940.00	0.61	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	19'500	7'250	26'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	5'000	4'000	0	9'000 CHF	99.35%	8'941'500.00	0.68	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	98.69%	1'480'350.00	0.11	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	2'000	2'165	0	4'165 CHF	99.73%	4'153'754.50	0.32	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	10'705	11'500	22'205	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	3'880	1'500	0	5'380 CHF	99.73%	5'365'474.00	0.41	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	3'850	2'200	0	6'050 CHF	99.77%	6'036'085.00	0.46	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	11'000	1'000	0	12'000 CHF	99.94%	11'992'800.00	0.91	a)
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	0	3'630	0	3'630 CHF	99.12%	3'598'056.00	0.27	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	0	4'000	0	4'000 CHF	99.21%	3'968'400.00	0.30	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	6'000	625	0	6'625 CHF	99.80%	6'611'750.00	0.50	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	13'230	4'000	5'000	12'230 CHF	99.97%	12'226'331.00	0.93	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	4'320	0	4'320 CHF	99.32%	4'290'624.00	0.33	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	0	3'500	0	3'500 CHF	98.97%	3'463'950.00	0.26	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	6'000	0	6'000 CHF	99.23%	5'953'800.00	0.45	a)
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	1'000	5'875	0	6'875 CHF	99.43%	6'835'812.50	0.52	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	4'750	4'875	4'750	4'875 CHF	99.34%	4'842'825.00	0.37	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	15'800	770	16'570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	3'850	2'100	5'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	12'430	0	12'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	12'200	7'750	6'000	13'950 CHF	99.92%	13'938'840.00	1.06	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	10'000	9'500	0	19'500 CHF	99.37%	19'377'150.00	1.47	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	10'500	0	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	10'060	0	10'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	12'225	13'790	0	26'015 CHF	99.91%	25'991'586.50	1.97	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	7'850	0	3'000	4'850 CHF	99.86%	4'843'210.00	0.37	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	6'000	0	1'300	4'700 CHF	99.78%	4'689'660.00	0.36	a)
CH0419040750	0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN	3'000	5'575	8'575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	0	4'600	0	4'600 CHF	99.25%	4'565'500.00	0.35	a)
CH0419040875	0.1250 % KOWEPW 0 1/8 02/27/24 EMTN	1'000	500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	9'000	16'300	0	25'300 CHF	99.35%	25'135'550.00	1.91	a)
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	0	1'700	0	1'700 CHF	99.70%	1'694'900.00	0.13	a)
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	12'230	2'000	0	14'230 CHF	99.63%	14'177'349.00	1.08	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	12'075	3'000	15'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	0	500	0	500 CHF	99.15%	495'750.00	0.04	a)
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	3'800	1'000	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186522	0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	99.24%	1'786'320.00	0.14	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	0	6'400	0	6'400 CHF	99.18%	6'347'520.00	0.48	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	7'075	0	7'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	0	11'440	0	11'440 CHF	99.17%	11'345'048.00	0.86	a)
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	3'915	0	3'915	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297419	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 11/08/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	0	19'510	0	19'510 CHF	99.04%	19'322'704.00	1.47	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	3'600	6'650	10'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	9'000	5'300	14'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112083	0.2500 % SLHNVX 0 1/4 10/11/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	20'710	1'000	21'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.51%	995'100.00	0.08	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	6'000	12'450	0	18'450 CHF	99.27%	18'315'315.00	1.39	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	2'000	8'150	0	10'150 CHF	99.30%	10'078'950.00	0.77	a)
CH0465767793	0.0000 % KORGAS 0 11/28/23	13'690	0	13'690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	15'000	10'225	5'000	20'225 CHF	99.51%	20'125'897.50	1.53	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	0	7'100	0	7'100 CHF	99.16%	7'040'360.00	0.53	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	0	9'665	0	9'665 CHF	99.16%	9'583'814.00	0.73	a)
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	0	6'375	0	6'375 CHF	99.04%	6'313'800.00	0.48	a)
CH0502393371	0.3800 % COMQAT 0.38 10/19/23 EMTN	5'200	0	5'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785737	0.1500 % SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN	0	7'850	0	7'850 CHF	99.03%	7'773'855.00	0.59	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	9'265	5'190	0	14'455 CHF	99.87%	14'436'208.50	1.10	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	0	4'420	0	4'420 CHF	99.38%	4'392'596.00	0.33	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	98.96%	6'927'200.00	0.53	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	0	16'080	0	16'080 CHF	99.20%	15'951'360.00	1.21	a)
CH0589645149	1.7400 % ZKB 1.74 07/09/24 CD	0	5'000	0	5'000 CHF	99.99%	4'999'650.00	0.38	a)
CH0589645172	1.4400 % ZKB 1.44 06/28/24 CD	0	15'000	0	15'000 CHF	100.01%	15'000'750.00	1.14	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	6'700	0	0	6'700 CHF	99.85%	6'689'950.00	0.51	a)
CH1145908047	0.0000 % SWISTB 0 06/27/24 0804	5'000	3'100	5'000	3'100 CHF	99.64%	3'088'778.00	0.23	a)
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	0	3'835	0	3'835 CHF	99.01%	3'797'033.50	0.29	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	99.41%	9'941'000.00	0.76	a)
CH1181991733	0.4400 % UBS 0.44 04/29/24 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	99.90%	5'994'180.00	0.46	a)
CH1193213183	2.0450 % BCSW 2.045 06/26/24	10'000	0	0	10'000 CHF	100.04%	10'004'300.00	0.76	a)
CH1204500917	0.0000 % SWNBK 0 10/30/23	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501667	0.0000 % SWNBK 0 01/03/24 30	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	5'275	0	5'275 CHF	100.40%	5'296'100.00	0.40	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROIL 2.15 12/19/24	0	1'870	0	1'870 CHF	100.50%	1'879'350.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	11'455	0	11'455 CHF	100.65%	11'529'457.50	0.88	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	0	6'180	0	6'180 CHF	100.22%	6'193'596.00	0.47	a)
CH1258960561	0.0000 % SWNBK 0 01/08/24 28	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960587	0.0000 % SWNBK 0 01/15/24 28	0	45'000	45'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960652	0.0000 % SWNBK 0 02/05/24 28	0	30'000	30'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960678	0.0000 % SWNBK 0 02/12/24 28	0	35'000	35'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960736	0.0000 % SWNBK 0 03/04/24 28	0	52'000	52'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960751	0.0000 % SWNBK 0 03/11/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960769	0.0000 % SWNBK 0 05/06/24 84	0	20'000	0	20'000 CHF	99.86%	19'971'800.00	1.52	a)
CH1258960777	0.0000 % SWNBK 0 03/18/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960785	0.0000 % SWNBK 0 08/05/24 168	0	10'000	0	10'000 CHF	99.51%	9'950'600.00	0.76	a)
CH1258960819	0.0000 % SWNBK 0 04/02/24 29	0	50'000	0	50'000 CHF	100.00%	50'000'000.00	3.80	a)
CH1258960843	0.0000 % SWNBK 0 06/03/24 84	0	40'000	0	40'000 CHF	99.74%	39'897'200.00	3.03	a)
CH1258960850	0.0000 % SWNBK 0 04/15/24 28	0	35'000	0	35'000 CHF	99.95%	34'980'750.00	2.66	a)
CH1262684413	2.0500 % UBS 2.05 04/28/24	14'000	0	0	14'000 CHF	100.03%	14'003'780.00	1.06	a)
CH1265890645	2.0550 % BCSW 2.055 10/17/24	0	5'000	0	5'000 CHF	100.13%	5'006'550.00	0.38	a)
CH1265890728	1.7675 % BCSW 1.7675 11/15/24	0	20'000	0	20'000 CHF	99.99%	19'998'400.00	1.52	a)
FR0014000IY3	0.0000 % BPCEGP FLOAT 09/11/25 EMTN	0	20'000	0	20'000 CHF	99.90%	19'980'000.00	1.52	a)
CHF							1'163'429'902.00	88.40	
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	0	25'000	0	25'000 EUR	98.94%	24'059'797.85	1.83	a)
FR0013255858	0.3750 % CAFFIL 0 3/8 05/11/24	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013421674	0.0000 % SFILFR 0 05/24/24 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	99.41%	3'674'462.62	0.28	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	0	25'000	0	25'000 EUR	96.98%	23'584'122.26	1.79	a)
XS1962595895	0.7500 % ASBBNK 0 3/4 03/13/24 EMTN	2'241	0	2'241	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979259220	0.3750 % MET 0 3/8 04/09/24	12'962	0	12'962	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	3'768	0	0	3'768 EUR	99.78%	3'657'338.06	0.28	a)
XS2002491517	1.0000 % NWG 1 05/28/24 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	99.55%	4'842'066.24	0.37	a)
EUR							59'817'787.03	4.55	
XS0422704071	7.5000 % LLOYDS 7 1/2 04/15/24 EMTN	6'000	0	0	6'000 GBP	100.06%	6'831'224.87	0.52	a)
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	3'000	3'000	0	6'000 GBP	99.00%	6'758'860.20	0.51	a)
GBP							13'590'085.07	1.03	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	500	0	500 JPY	99.98%	2'975.08	0.00	a)
JPY							2'975.08	0.00	
US22550UAF84	6.6186 % UBS FLOAT 02/21/25 FRN	0	4'000	0	4'000 USD	100.44%	3'618'616.29	0.27	a)
US63859UBG76	0.5500 % NWIDE 0.55 01/22/24 144A	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80283LAJ26	4.0000 % SANUK 4 03/13/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	0	40'000	0	40'000 USD	98.98%	35'659'276.12	2.71	a)
USD							39'277'892.41	2.98	
Derivative Finanzinstrumente							-598'201.24	-0.05	

Devisentermingeschäfte

CAD/CHF	Verfall 05.10.2023	4'827'973	7'450'000	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 05.10.2023	1'826'931	3'235'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 05.10.2023	3'097'980	3'500'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 05.10.2023	9'935'359	10'425'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 05.10.2023	3'000'000	1'960'314	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 05.10.2023	2'100'000	2'005'036	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 05.10.2023	3'200'000	2'151'920	CAD/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	1'263'206	1'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 02.11.2023	1'300'000	1'270'061	EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023	10'003'010	9'050'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2023	3'215'212	3'500'000	CHF/USD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023	838'164	1'250'000	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023	1'879'862	3'235'000	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	8'026'124	8'325'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 02.11.2023	3'300'000	2'976'953	USD/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 11.01.2024	2'278'498	3'650'000	CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 11.01.2024	5'867'933	6'650'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 11.01.2024	6'650'000	5'951'211	USD/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 11.01.2024	1'844'387	3'235'000	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024	7'940'277	8'325'000	CHF/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		9'847'812	9'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		179'007	200'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		809'638	1'250'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		5'000'000	4'783'615		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		162'677	250'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 01.02.2024		3'659'227	5'900'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 01.02.2024		3'917'951	6'885'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 01.02.2024		953'240	1'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 01.02.2024		169'698	200'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 01.02.2024		9'775'195	9'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 01.02.2024		3'088'985	3'325'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 01.02.2024		5'600'000	3'191'782		AUD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		964'559	1'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		2'216'399	3'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		3'168'480	4'950'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		1'160'395	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.03.2024		1'294'220	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 07.03.2024		3'300'000	1'954'026		AUD/CHF	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 07.03.2024		4'084'313	7'185'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		962'711	1'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 07.03.2024		9'871'242	9'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.03.2024		172'012	200'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		3'100'765	3'325'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		0	0		CHF/EUR	-36'927.94	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		0	0		CHF/EUR	-42'404.78	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		0	0		CHF/EUR	-129'112.84	-0.01	b)	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		0	0		CHF/CAD	-20'492.74	0.00	b)	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		12'000'000	11'418'648		EUR/CHF	248'845.24	0.02	b)	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		10'141'439	9'050'000		CHF/GBP	-148'263.17	-0.01	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		5'302'641	5'525'000		CHF/EUR	-69'280.01	-0.01	b)	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		1'502'555	1'700'000		CHF/USD	-27'485.35	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		6'406'194	9'850'000		CHF/CAD	-145'530.23	-0.01	b)	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2024		10'100'000	6'556'193		CAD/CHF	161'815.11	0.01	b)	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		2'300'000	2'205'364		EUR/CHF	30'909.98	0.00	b)	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		1'700'000	1'487'696		USD/CHF	42'340.94	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		0	0		CHF/EUR	-48'111.12	0.00	b)	
	CHF/EUR Verfall 02.05.2024		3'500'000	3'324'685		EUR/CHF	71'797.72	0.01	b)	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		16'021'632	16'500'000		CHF/EUR	9'159.09	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 06.06.2024		3'609'299	3'780'000		CHF/EUR	-50'188.07	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		1'300'529	1'500'000		CHF/USD	-40'327.09	0.00	b)	
	CHF/USD Verfall 06.06.2024		350'000	304'258		USD/CHF	8'610.72	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		35'413'189	39'550'000		CHF/USD	56'194.84	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		290'686	325'000		CHF/USD	142.22	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 04.07.2024		3'175'286	2'950'000		CHF/GBP	-146'989.02	-0.01	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.07.2024		15'951'606	16'500'000		CHF/EUR	6'568.74	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2024		4'777'298	8'500'000		CHF/AUD	-137'569.35	-0.01	b)	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2024		3'017	500'000		CHF/JPY	13.94	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2024		3'056'649	4'900'000		CHF/CAD	-127'585.39	-0.01	b)	
	USD/CHF Verfall 06.02.2025		2'155'245	2'550'000		CHF/USD	-63'625.31	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 06.02.2025		15'259'184	16'000'000		CHF/EUR	-707.37	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte								-598'201.24	-0.05	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'608'878.26	0.27
Geldmarktinstrumente	19'866'794.79	1.51
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'287'485'058.84	97.83
Derivative Finanzinstrumente	-598'201.24	-0.05
Sonstige Vermögenswerte	5'723'241.91	0.43
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'316'085'772.56	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-74'113.33	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'316'011'659.23	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'287'485'058.84	97.83
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	19'268'593.55	1.46

		Kurswert CHF	in % 7)
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten

					89'616'439.48	6.81
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte					89'616'439.48	6.81
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	31'965	CHF	99.96%	31'952'214.00	2.43
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	1'000	CHF	99.76%	997'600.00	0.08
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	5'000	CHF	99.97%	4'998'500.00	0.38
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	500	CHF	99.57%	497'850.00	0.04
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	600	CHF	99.70%	598'200.00	0.05
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	500	CHF	99.24%	496'200.00	0.04
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	2'000	CHF	99.26%	1'985'200.00	0.15
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	500	CHF	99.15%	495'750.00	0.04
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	400	CHF	99.35%	397'400.00	0.03
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	5'000	CHF	99.80%	4'990'000.00	0.38
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	500	CHF	99.55%	497'750.00	0.04
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	500	CHF	99.08%	495'400.00	0.04
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	350	CHF	99.77%	349'195.00	0.03
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	3'590	CHF	99.80%	3'582'820.00	0.27
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	500	CHF	99.97%	499'850.00	0.04
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	500	CHF	99.92%	499'600.00	0.04
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	1'500	CHF	99.25%	1'488'750.00	0.11
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	500	CHF	99.15%	495'750.00	0.04
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	19'510	CHF	99.04%	19'322'704.00	1.47
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	500	CHF	99.51%	497'550.00	0.04
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	1'000	CHF	99.51%	995'100.00	0.08
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	500	CHF	98.96%	494'800.00	0.04
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	5'000	CHF	99.85%	4'992'500.00	0.38
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	2'000	CHF	99.01%	1'980'200.00	0.15
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	3'000	CHF	100.22%	3'006'600.00	0.23
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	3'100	EUR	99.78%	3'008'956.48	0.23

OTC Gegenparteien

Cooperatieve Rabobank UA

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.58761668
CAD	1 = CHF	0.66558286
EUR	1 = CHF	0.97275172
GBP	1 = CHF	1.13780928
JPY	100 = CHF	0.59513000
NOK	100 = CHF	8.30245400
NZD	1 = CHF	0.53875371
SEK	100 = CHF	8.42358300
USD	1 = CHF	0.90070000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	63'846'778.25	67.636
Bond	CHF	30'533'864.75	32.346
Equity	CHF	17'354.06	0.018
Total	CHF	94'397'997.06	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	25'883'802.51	1.967
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	149'392'665.27	11.352

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
FT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
VT CHF	CHF	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	89'616'439.48
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

8 Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission (PVK) wird verwendet für die Leitung, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.110	0.500	0.080	0.030	4.000
FT CHF	0.140	0.600	0.090	0.050	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

Periode: 23.01.2024 - 31.03.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
VT CHF	0.250	0.600	0.200	0.050	4.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

9 Benchmark

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit

10 TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert 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 in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Nettoinventarwertes des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden 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.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden 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 offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite 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 Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Der Nettoinventarwert eines jeden Teilvermögens wird auf 0.0001 der jeweiligen Rechnungseinheit gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird 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 Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen

oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.