

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE BALANCE

Halbjahresbericht per 31.03.2024

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

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	237927	CHF
CT CHF	37873490	CHF
GT CHF	133352654	CHF
NT CHF	125147660	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	23
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	23
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	24
8	Pauschale Verwaltungskommission	24
9	Benchmark	24
10	TER	24
11	Fussnoten	25
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26

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		851'872'768.31	781'430'657.56	733'792'558.67	861'313'036.93
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		358'132.580	-	-	-
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		814'960'100.72	752'671'871.07	713'565'999.31	836'259'369.38
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		524'461.383	523'048.139	517'035.784	512'705.070
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'553.8992	1'439.0107	1'380.1095	1'631.0700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'556.5408	1'441.4570	1'382.4557	1'631.8900
Ausschüttung je Anteil		-	7.25	4.35	3.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.40 %	1.41 %	1.40 %	1.42 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'958'913.74	21'278'628.49	20'226'559.36	25'053'667.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		198'673.322	208'756.005	208'104.036	219'298.516
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.5277	101.9306	97.1945	114.2400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		110.7156	102.1039	97.3597	114.3000
Thesaurierung je Anteil		-	1.14	0.99	0.89
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.78 %	0.79 %	0.78 %	0.80 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'128.93			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.2893			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		101.4615			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.60 %			
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'943'624.92	7'480'158.00		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		137'059.655	74'588.684		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.0301	100.2854		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		109.2154	100.4559		
Thesaurierung je Anteil		-	1.41		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.05 %	0.06 %		

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

Performance

	-	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	8.51 %	4.62 %	-14.88 %	6.91 %
Klasse CT CHF	8.85 %	5.27 %	-14.34 %	7.58 %
Klasse GT CHF (Lancierung 14.03.2024)	1.46 %	-	-	-
Klasse NT CHF (Lancierung 06.03.2023)	9.24 %	2.81 %	-	-

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.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.03.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	18'001'572.11	5'206'323.64
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	358'892'351.04	320'286'153.37
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	8'226'343.72	265'873'649.05
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	461'509'561.64	187'913'250.75
Andere Anlagen - Metallkonten	3'791'478.05	1'711.13
Derivative Finanzinstrumente	835'599.05	-282'248.62
Sonstige Vermögenswerte	1'519'841.49	3'287'977.48
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	852'776'747.10	782'286'816.80
Andere Verbindlichkeiten	-903'978.79	-856'159.24
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	851'872'768.31	781'430'657.56

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		523'048.139	517'035.784
Ausgegebene Anteile		25'795.175	45'947.903
Zurückgenommene Anteile		-24'381.931	-39'935.548
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		524'461.383	523'048.139

Klasse CT CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		208'756.005	208'104.036
Ausgegebene Anteile		10'556.822	34'997.554
Zurückgenommene Anteile		-20'639.505	-34'345.585
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		198'673.322	208'756.005

Klasse GT CHF	von bis	Lancierung 14.03.2024 31.03.2024
Ausgegebene Anteile		100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000

Klasse NT CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	Lancierung 06.03.2023 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		74'588.684	-
Ausgegebene Anteile		62'616.805	74'588.684
Zurückgenommene Anteile		-145.834	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		137'059.655	74'588.684

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		781'430'657.56	733'792'558.67
Ausbezahlte Ausschüttung		-3'782'543.60	-2'258'355.66
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-142'557.21	-70'591.41
Saldo aus dem Anteilverkehr		7'444'219.15	16'305'393.07
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		66'922'992.41	33'661'652.89
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		851'872'768.31	781'430'657.56

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		87'051.55	130'844.54
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-970.93	-3'910.08
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		3'085'335.21	7'019'249.84
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'570'661.27	2'846'980.72
Erträge der Gratisaktien		6'479.97	337.28
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'156'287.69	4'245'091.68
Erträge aus Wertpapierleihe		49'142.25	103'850.90
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-5'179.89	106'884.59
Total Ertrag		5'948'807.12	14'449'329.47
Aufwand			
Passivzinsen		-108.74	-1'019.34
Reglementarische Vergütungen		-5'195'634.22	-10'231'378.58
Sonstige Aufwendungen		-2'327.38	-782.03
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		15'071.83	-72'604.35
Total Aufwand		-5'182'998.51	-10'305'784.30
Nettoertrag / Verlust		765'808.61	4'143'545.17
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-31'157'455.48	-17'105'570.85
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		24'026.56	320'749.93
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		62'378.62	110'575.94
Realisierter Erfolg		-30'305'241.69	-12'530'699.81
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		97'228'234.10	46'192'352.70
Gesamterfolg		66'922'992.41	33'661'652.89

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							425'522'673.93	49.90	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							358'892'351.04	42.09	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	445	378	445	378 USD	1'511.96	514'768.86	0.06	a)
AR							514'768.86	0.06	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	5'218	0	0	5'218 EUR	41.30	209'631.30	0.02	a)
AT							209'631.30	0.02	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29'655	0	0	29'655 AUD	43.00	749'308.22	0.09	a)
AU000000APA1	APA GROUP	43'872	0	43'872	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	0	56'837	0	56'837 AUD	25.70	858'338.09	0.10	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	92'858	74'684	167'542	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	36'709	155'842	192'551	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	85'946	0	8'261	77'685 AUD	18.13	827'616.40	0.10	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	179'088	0	179'088 AUD	3.39	356'746.98	0.04	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	9'645	9'569	19'214	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	43'204	0	43'204	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	0	173'704	0	173'704 AUD	2.13	217'412.01	0.03	a)
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	115'151	106'542	0	221'693 AUD	5.51	717'790.48	0.08	a)
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	36'208	36'144	36'208	36'144 AUD	30.50	647'783.93	0.08	a)
AU							4'374'996.11	0.51	
BE0003565737	KBC GROUP NV	7'231	2'413	0	9'644 EUR	69.42	651'244.12	0.08	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	3'945	0	3'945	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE							651'244.12	0.08	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	137'219	0	137'219 USD	6.10	754'162.08	0.09	a)
BM							754'162.08	0.09	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	8'057	48'141	8'057	48'141 CAD	24.15	773'810.06	0.09	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	39'167	0	39'167	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	0	8'891	0	8'891 CAD	77.31	457'497.17	0.05	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	26'215	0	26'215 CAD	29.92	522'051.78	0.06	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	12'397	0	12'397 CAD	56.90	469'495.03	0.06	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	0	27'976	13'497	14'479 CAD	68.67	661'771.02	0.08	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	23'110	5'674	23'110	5'674 CAD	30.85	116'505.55	0.01	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	3'238	3'683	6'921	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	10'936	0	10'936	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	17'215	0	17'215 CAD	8.31	95'216.05	0.01	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	7'477	0	7'477 CAD	150.10	746'982.11	0.09	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	47'242	0	47'242	0 CAD	33.83	1'063'732.44	0.12	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	10'669	0	10'669	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	37'181	2'942	0	40'123 CAD	22.13	590'985.66	0.07	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	4'875	13'536	10'068	8'343 CAD	73.59	408'642.16	0.05	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	3'997	0	3'997	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	15'911	0	15'911	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA70137W1086	PARKLAND CORP	9'934	3'368	13'302	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	24'905	0	24'905 CAD	47.81	792'514.87	0.09	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	10'179	16'198	0	26'377 CAD	37.98	666'779.88	0.08	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	5'397	5'397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	0	3'476	3'476	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	9'248	9'248	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	9'949	10'754	9'949	10'754 CAD	73.91	529'023.99	0.06	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	26'740	0	26'740	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	4'739	13'664	18'403	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA							7'895'007.77	0.93	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	3'057	1'516	0	4'573 CHF	551.40	2'521'552.20	0.30	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	1'014	179	381	812 CHF	4'016.00	3'260'992.00	0.38	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.
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18'515	105	0	18'620 CHF	486.30	9'054'906.00	1.06	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	195'629	4'147	3'580	196'196 CHF	87.37	17'141'644.52	2.01	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	76'427	1'798	3'024	75'201 CHF	229.70	17'273'669.70	2.03	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	38'018	0	5'085	32'933 CHF	81.66	2'689'308.78	0.32	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	135'604	780	7'787	128'597 CHF	41.89	5'386'928.33	0.63	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	4'966	1'917	710	6'173 CHF	261.10	1'611'770.30	0.19	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	11'910	1'179	2'329	10'760 CHF	540.20	5'812'552.00	0.68	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	5'601	31	0	5'632 CHF	632.20	3'560'550.40	0.42	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3'350	19	60	3'309 CHF	1'288.00	4'261'992.00	0.50	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	6'528	0	6'528 CHF	251.00	1'638'528.00	0.19	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	1'638	268	369	1'537 CHF	533.00	819'221.00	0.10	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	292'554	1'861	11'329	283'086 CHF	95.75	27'105'484.50	3.18	a)
CH0114405324	GARMIN LTD	0	909	909	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0126881561	SWISS RE AG	11'875	0	1'372	10'503 CHF	115.95	1'217'822.85	0.14	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	58'573	8'461	5'855	61'179 CHF	137.50	8'412'112.50	0.99	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	305'824	1'738	13'765	293'797 CHF	27.74	8'149'928.78	0.96	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	10'565	2'741	0	13'306 CHF	268.60	3'573'991.60	0.42	a)
CH0432492467	ALCON INC	86'039	0	7'961	78'078 CHF	74.74	5'835'549.72	0.68	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	1'378	1'378	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	39'125	39'125	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH							129'328'505.18	15.17	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	34'714	9'546	7'804	36'456 EUR	14.58	517'116.17	0.06	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	4'994	0	4'994 EUR	66.90	324'994.99	0.04	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10'371	10'107	10'371	10'107 EUR	74.50	732'454.32	0.09	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	3'135	0	3'135	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	8'357	8'921	17'278	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	5'218	3'468	2'145	6'541 EUR	180.46	1'148'225.29	0.13	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	8'144	0	974	7'170 EUR	176.96	1'234'230.50	0.14	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	3'030	0	3'030 EUR	277.80	818'798.20	0.10	a)
DE000A1EWWWO	ADIDAS AG	4'667	0	4'667	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	52'363	0	0	52'363 EUR	12.89	656'312.92	0.08	a)
DE							5'432'132.39	0.64	
DK0010181759	CARLSBERG A/S-B	0	719	719	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	5'743	0	0	5'743 DKK	1'114.50	834'720.42	0.10	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	4'650	5'108	9'758	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	15'521	3'659	4'965	14'215 DKK	881.30	1'633'777.03	0.19	a)
DK							2'468'497.45	0.29	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	8'613	0	8'613	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	31'873	0	0	31'873 EUR	11.04	342'289.85	0.04	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	1'916	5'343	1'026	6'233 EUR	112.85	684'227.77	0.08	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	15'430	0	15'430	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	40'247	0	40'247 EUR	15.81	618'771.10	0.07	a)
ES							1'645'288.72	0.19	
FI0009007884	ELISA OYJ	5'988	9'392	0	15'380 EUR	41.35	618'634.10	0.07	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	5'878	0	5'878	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	24'091	0	24'091	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
FI							618'634.10	0.07	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	52'507	0	52'507 EUR	13.82	705'669.81	0.08	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	6'261	13'719	8'232	11'748 EUR	63.47	725'328.00	0.09	a)
FR0000120578	SANOFI	5'327	0	5'327	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	34'044	6'111	9'845	30'310 EUR	34.82	1'026'489.10	0.12	a)
FR0000120644	DANONE	13'489	0	0	13'489 EUR	59.89	785'843.52	0.09	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	474	0	190	284 EUR	833.70	230'319.20	0.03	a)
FR0000121220	SODEXO SA	1'203	0	1'203	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	2'106	2'106	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	14'981	0	4'304	10'677 EUR	24.00	249'265.68	0.03	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2'911	5'367	2'911	5'367 EUR	209.65	1'094'532.02	0.13	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	15'009	0	15'009	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	7'130	0	4'158	2'972 EUR	101.05	292'137.38	0.03	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	23'275	6'523	29'798	0 EUR	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.
FR0000131104	BNP PARIBAS	15'841	2'556	2'662	15'735	EUR	65.86	1'008'069.51	0.12 a)
FR0010208488	ENGIE	14'939	32'436	12'233	35'142	EUR	15.51	530'200.68	0.06 a)
FR0010307819	LEGRAND SA	8'048	0	8'048	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0013176526	VALEO	11'875	19'241	31'116	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	12'035	0	12'035	EUR	41.04	480'458.03	0.06 a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	23'447	0	23'447	EUR	35.52	810'144.05	0.10 a)
FR								7'938'456.98	0.93
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	7'849	0	2'941	4'908	AUD	121.76	351'158.60	0.04 a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	26'120	82'416	0	108'536	GBP	671.40	829'133.80	0.10 a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	164'599	0	91'358	73'241	GBP	619.00	515'839.25	0.06 a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	60'913	0	60'913	GBP	1'042.00	722'182.86	0.08 a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	10'516	0	10'516	GBP	5'017.00	600'294.20	0.07 a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	2'229	0	0	2'229	GBP	10'678.00	270'812.97	0.03 a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	242'692	0	169'971	72'721	GBP	183.20	151'584.49	0.02 a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	21'687	27'328	0	49'015	GBP	1'213.00	676'486.73	0.08 a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	115'513	0	115'513	GBP	270.40	355'391.49	0.04 a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	411'162	0	0	411'162	GBP	127.65	597'177.25	0.07 a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	13'556	3'939	17'495	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	0	2'535	2'535	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	29'488	0	29'488	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00B2B0DG97	RELX PLC	23'316	0	0	23'316	GBP	3'424.00	908'358.48	0.11 a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	22'352	0	22'352	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	4'763	0	4'763	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	3'927	0	1'687	2'240	USD	69.95	141'128.88	0.02 a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	846'332	0	846'332	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	46'990	0	46'990	GBP	220.50	117'891.78	0.01 a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	245'482	0	0	245'482	GBP	296.60	828'438.49	0.10 a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	168'653	168'653	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	66'959	0	66'959	GBP	831.20	633'262.79	0.07 a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	12'978	4'570	0	17'548	GBP	1'708.60	341'143.82	0.04 a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	54'186	11'159	35'175	30'170	GBP	2'625.00	901'102.28	0.11 a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	0	25'838	25'838	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	41'333	0	41'333	GBP	700.20	329'297.56	0.04 a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	36'783	0	36'783	GBP	658.20	275'470.12	0.03 a)
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	11'348	0	0	11'348	USD	85.44	873'294.51	0.10 a)
IE00BJVNS543	FERGUSON PLC	5'531	0	726	4'805	GBP	17'291.11	945'335.23	0.11 a)
GB								11'364'785.58	1.33
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	0	43'600	43'600	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	98'000	0	98'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	467'000	285'000	752'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	10'800	0	10'800	HKD	85.65	106'455.10	0.01 a)
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	137'000	137'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	274'000	25'000	0	299'000	HKD	20.95	720'892.62	0.08 a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	0	107'000	107'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	160'600	160'600	0	HKD	0.00	0.00	0.00
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	38'000	0	38'000	HKD	25.45	111'297.84	0.01 a)
HK								938'645.56	0.11
CRH ID	CRH PLC	10'000	0	10'000	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE0001827041	CRH PLC	0	10'000	2'638	7'362	GBP	6'828.00	571'950.97	0.07 a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	6'312	0	6'312	EUR	42.27	259'538.17	0.03 a)
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	2'286	2'706	384	4'608	USD	346.61	1'438'579.02	0.17 a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1'770	0	1'770	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	65'766	10'671	76'437	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	4'005	489	3'516	USD	300.20	950'691.73	0.11 a)
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	11'323	11'323	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE								3'220'759.89	0.38
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	1'684	0	0	1'684	USD	164.01	248'766.89	0.03 a)
IL								248'766.89	0.03
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	44'082	0	6'365	37'717	EUR	23.46	860'730.43	0.10 a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	240'994	0	0	240'994	EUR	3.36	788'379.10	0.09 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.
IT0003128367	ENEL SPA	0	20'381	20'381	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	28'456	0	0	28'456 EUR	11.61	321'233.63	0.04	a)
IT							1'970'343.16	0.23	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	206'080	0	206'080	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	21'760	0	21'760	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	6'452	0	0	6'452 EUR	145.20	911'303.38	0.11	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	4'580	0	0	4'580 USD	247.77	1'022'102.29	0.12	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	661	177	129	709 EUR	892.20	615'333.36	0.07	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	175	0	175	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	9'205	0	9'205	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011821202	ING GROEP NV	0	11'428	0	11'428 EUR	15.25	169'483.79	0.02	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	4'355	8'861	4'355	8'861 EUR	69.18	596'300.68	0.07	a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	11'085	11'085	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							3'314'523.50	0.39	
NO0010096985	EQUINOR ASA	14'788	0	14'788	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	17'835	0	17'835 NOK	269.80	399'504.37	0.05	a)
NO							399'504.37	0.05	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	3'508	2'509	0	6'017 NZD	34.25	111'027.58	0.01	a)
NZ							111'027.58	0.01	
PTGAL0AM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	10'608	2'833	13'441	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PT							0.00	0.00	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	46'024	0	11'265	34'759 SEK	174.58	511'162.07	0.06	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	40'793	0	6'866	33'927 SEK	290.10	829'067.80	0.10	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	14'122	10'969	25'091	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	32'883	32'883	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	21'153	0	21'153 SEK	307.10	547'203.22	0.06	a)
SE							1'887'433.09	0.22	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	28'981	0	28'981	0 USD	0.00	0.00	0.00	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	89'578	0	0	89'578 SGD	13.49	806'470.35	0.09	a)
SG							806'470.35	0.09	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	11'935	0	11'935 USD	54.81	589'199.53	0.07	a)
BMG491BT1088	INVESCO LTD	39'066	11'274	50'340	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	3'559	0	3'559	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059YS762	LINDE PLC	1'084	0	600	484 USD	464.32	202'415.10	0.02	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	5'004	0	4'210	794 USD	312.68	223'614.92	0.03	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	14'742	0	14'742	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	1'453	0	1'453 USD	86.91	113'740.60	0.01	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	3'074	3'074	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	57'289	13'973	50'293	20'969 USD	17.60	332'407.30	0.04	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	4'958	0	3'230	1'728 USD	113.66	176'901.52	0.02	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	3'545	5'251	0	8'796 USD	182.10	1'442'697.67	0.17	a)
US00724F1012	ADOBE INC	3'307	364	169	3'502 USD	504.60	1'591'635.26	0.19	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	4'131	1'406	0	5'537 USD	180.49	900'135.38	0.11	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	1'756	0	1'756 USD	108.76	172'017.99	0.02	a)
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	27'518	0	27'518	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	10'967	6'117	3'347	13'737 USD	152.26	1'883'900.17	0.22	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	42'915	940	7'622	36'233 USD	150.93	4'925'610.07	0.58	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	4'522	0	4'522	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0231351067	AMAZON.COM INC	41'630	2'719	0	44'349 USD	180.38	7'205'305.13	0.84	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	6'535	0	0	6'535 USD	227.69	1'340'200.30	0.16	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	5'649	4'431	5'649	4'431 USD	197.59	788'582.03	0.09	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	2'904	846	3'750	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	0	1'648	0	1'648 USD	438.44	650'799.99	0.08	a)
US0311621009	AMGEN INC	3'348	1'389	0	4'737 USD	284.32	1'213'084.23	0.14	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	0	19'820	19'820	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	2'363	0	2'363	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	1'573	1'007	0	2'580 USD	518.54	1'204'986.36	0.14	a)
US0378331005	APPLE INC	69'551	0	11'059	58'492 USD	171.48	9'034'208.49	1.06	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	0	7'290	0	7'290 USD	206.23	1'354'127.42	0.16	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.
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	5'959	5'959	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	603	3'104	0	3'707 USD	260.42	869'515.01	0.10	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	1'115	3'394	0	4'509 USD	249.74	1'014'258.15	0.12	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	44	32	76	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	1'460	1'460	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	10'497	0	0	10'497 USD	37.92	358'520.25	0.04	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	19'963	0	0	19'963 USD	57.62	1'036'046.44	0.12	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	3'183	0	3'183	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	394	0	0	394 USD	3'627.88	1'287'446.82	0.15	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	6'865	0	6'865	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	10'808	2'061	8'747 USD	65.31	514'539.80	0.06	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	18'803	5'100	0	23'903 USD	54.23	1'167'541.10	0.14	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	3'714	493	0	4'207 USD	204.86	776'264.71	0.09	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	1'538	620	628	1'530 USD	1'325.41	1'826'509.08	0.21	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0	2'369	2'369	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	3'719	1'203	1'972	2'950 USD	208.55	554'130.91	0.06	a)
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0	2'256	2'256	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	0	4'420	933	3'487 USD	363.19	1'140'685.69	0.13	a)
US1264081035	CSX CORP	0	11'374	0	11'374 USD	37.07	379'765.91	0.04	a)
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	26'476	0	26'476	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	4'145	0	4'145	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	15'779	0	15'779	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2'628	4'567	0	7'195 USD	148.89	964'887.08	0.11	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	7'066	5'766	4'657	8'175 USD	111.90	823'944.60	0.10	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	2'835	1'544	0	4'379 USD	366.43	1'445'260.49	0.17	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	0	2'985	0	2'985 USD	78.48	211'000.50	0.02	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1'435	900	2'335	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	5'681	5'681	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	12'021	2'412	11'182	3'251 USD	157.74	461'890.43	0.05	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	358	0	118	240 USD	2'906.77	628'350.66	0.07	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	8'009	8'079	8'009	8'079 USD	104.31	759'038.35	0.09	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	29'425	2'291	0	31'716 USD	49.91	1'425'759.07	0.17	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	1'537	0	1'537 USD	687.03	951'107.77	0.11	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	0	14'974	0	14'974 USD	63.24	852'923.05	0.10	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	4'440	4'440	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	28'191	2'737	20'111	10'817 USD	61.18	596'068.90	0.07	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	1'141	0	1'141 USD	73.29	75'320.04	0.01	a)
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	0	11'863	0	11'863 USD	90.05	962'184.62	0.11	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	33'770	2'291	0	36'061 USD	43.35	1'408'014.19	0.17	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	10'908	0	10'908	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	8'951	529	0	9'480 USD	90.81	775'393.54	0.09	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	0	8'701	0	8'701 USD	57.67	451'959.25	0.05	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	635	0	0	635 USD	732.63	419'023.70	0.05	a)
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	8'273	5'109	8'867	4'515 USD	105.83	430'374.68	0.05	a)
US2358511028	DANAHER CORP	528	0	528	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	5'251	618	5'251	618 USD	167.15	93'041.14	0.01	a)
US23918K1088	DAVITA INC	3'145	3'490	4'862	1'773 USD	138.05	220'457.72	0.03	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	1'207	0	1'087	120 USD	941.26	101'735.15	0.01	a)
US2441991054	DEERE & CO	0	843	0	843 USD	410.74	311'870.82	0.04	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	2'719	0	2'719	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	19'532	0	19'532 USD	50.18	882'790.27	0.10	a)
US2521311074	DEXCOM INC	2'127	0	2'127	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	8'426	3'843	4'583 USD	198.17	818'027.55	0.10	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9'408	0	5'210	4'198 USD	131.09	495'669.46	0.06	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	1'708	0	1'708 USD	59.55	91'611.46	0.01	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	219	0	219 USD	496.88	98'011.22	0.01	a)
US2605571031	DOW INC	16'200	0	16'200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	9'730	0	0	9'730 USD	24.30	212'960.61	0.02	a)
US2786421030	EBAY INC	10'893	7'738	0	18'631 USD	52.78	885'698.10	0.10	a)
US2788651006	ECOLAB INC	4'953	0	4'953	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10'527	2'035	3'268	9'294 USD	95.56	799'942.87	0.09	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.
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	0	7'533	0	7'533 USD	132.67	900'162.38	0.11	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	9'850	8'115	9'850	8'115 USD	113.42	829'007.25	0.10	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	820	0	820 USD	120.98	89'352.68	0.01	a)
US29444U7000	EQUINIX INC	1'219	1'044	1'219	1'044 USD	825.33	776'083.22	0.09	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	8'871	14'183	0	23'054 USD	38.01	789'267.68	0.09	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	0	10'098	10'098	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	12'607	0	12'607	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	12'536	0	1'116	11'420 USD	116.24	1'195'643.94	0.14	a)
US3024913036	FMC CORP	10'926	6'796	15'750	1'972 USD	63.70	113'142.69	0.01	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	7'120	765	0	7'885 USD	485.58	3'448'598.63	0.40	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	2'301	348	2'649	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3156161024	F5 INC	0	455	0	455 USD	189.59	77'697.49	0.01	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	15'006	4'637	12'396	7'247 USD	74.18	484'200.52	0.06	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	17'701	0	17'701	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	5'226	0	5'226	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	10'802	3'156	10'802	3'156 USD	86.02	244'521.24	0.03	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	0	10'514	0	10'514 USD	84.67	801'821.50	0.09	a)
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	8'257	8'257	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	6'258	13'510	0	19'768 USD	28.62	509'580.18	0.06	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	5'994	5'994	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	13'143	0	0	13'143 USD	69.97	828'297.87	0.10	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	2'600	1'452	4'052	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	14'284	1'302	0	15'586 USD	73.25	1'028'306.22	0.12	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	0	3'190	0	3'190 USD	417.69	1'200'120.69	0.14	a)
US3841091040	GRACO INC	5'788	0	5'788	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	WW GRAINGER INC	943	0	943	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	3'165	0	3'165	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	10'839	0	10'839 USD	103.05	1'006'044.93	0.12	a)
US4180561072	HASBRO INC	0	21'383	5'941	15'442 USD	56.52	786'114.60	0.09	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	0	3'117	3'117	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0	1'067	0	1'067 USD	213.31	205'000.91	0.02	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	9'790	0	9'790	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	1'940	4'140	0	6'080 USD	383.60	2'100'691.80	0.25	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	0	42'252	0	42'252 USD	20.68	787'005.86	0.09	a)
US4435106079	HUBBELL INC	2'039	0	0	2'039 USD	415.05	762'250.66	0.09	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	316	0	316	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	0	2'422	0	2'422 USD	346.72	756'368.09	0.09	a)
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	0	63'927	63'927	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	0	1'463	0	1'463 USD	137.32	180'949.87	0.02	a)
US45337C1027	INCYTE CORP	12'080	0	0	12'080 USD	56.97	619'859.58	0.07	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	8'658	0	8'658 USD	94.95	740'444.84	0.09	a)
US45784P1012	INSULET CORP	0	1'854	0	1'854 USD	171.40	286'220.48	0.03	a)
US4581401001	INTEL CORP	0	17'203	7'440	9'763 USD	44.17	388'410.40	0.05	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	6'166	1'782	0	7'948 USD	190.96	1'367'037.50	0.16	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	15'859	8'591	0	24'450 USD	39.02	859'302.93	0.10	a)
US4612021034	INTUIT INC	2'565	0	0	2'565 USD	650.00	1'501'692.08	0.18	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	1'568	645	1'568	645 USD	399.09	231'851.93	0.03	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	10'261	2'072	7'763	4'570 USD	80.21	330'160.32	0.04	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	12'355	0	1'608	10'747 USD	200.30	1'938'868.53	0.23	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	7'061	8'300	0	15'361 USD	158.19	2'188'661.90	0.26	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	6'690	9'234	6'690	9'234 USD	37.06	308'230.38	0.04	a)
US4878361082	KELLANOVA	11'715	8'436	4'733	15'418 USD	57.29	795'585.81	0.09	a)
US49177J1025	KENVUE INC	0	18'759	18'759	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	25'620	25'620	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	35'413	0	35'413 USD	15.81	504'283.49	0.06	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5'632	686	5'632	686 USD	156.38	96'624.11	0.01	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	6'141	1'359	0	7'500 USD	129.35	873'791.59	0.10	a)
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	0	9'591	9'591	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	0	91'889	42'941	48'948 USD	18.34	808'564.08	0.09	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	21'743	0	21'743 USD	36.90	722'646.65	0.08	a)
US5018892084	LKQ CORP	0	16'868	16'868	0 USD	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.
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	5'157	945	4'212 USD	218.46	828'782.28	0.10	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	1'523	0	211	1'312 USD	971.57	1'148'122.15	0.13	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	4'512	0	1'142	3'370 USD	777.96	2'361'387.89	0.28	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	3'233	2'323	3'233	2'323 USD	254.73	532'978.23	0.06	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	33'519	115'907	149'426	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	20'235	11'045	0	31'280 USD	28.34	798'448.21	0.09	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	4'235	2'416	2'529	4'122 USD	201.50	748'106.11	0.09	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	5'404	0	1'523	3'881 USD	481.57	1'683'384.13	0.20	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	860	0	0	860 USD	281.95	218'399.03	0.03	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	901	1'810	2'711	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	16'711	1'015	0	17'726 USD	131.95	2'106'688.39	0.25	a)
US59156R1086	METLIFE INC	0	13'295	0	13'295 USD	74.11	887'452.91	0.10	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	32'593	0	734	31'859 USD	420.72	12'072'729.23	1.42	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5'314	0	5'314	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	4'808	0	4'808	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0	5'645	5'645	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11'540	0	0	11'540 USD	67.25	699'001.75	0.08	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	0	10'560	0	10'560 USD	70.00	665'797.44	0.08	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	5'709	7'527	13'236	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	1'262	4'999	0	6'261 USD	104.97	591'955.51	0.07	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	363	1'000	468	895 USD	607.33	489'584.81	0.06	a)
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	711	0	711 USD	137.92	88'323.65	0.01	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	14'531	0	14'531	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELock INC	0	9'693	0	9'693 USD	22.40	195'562.87	0.02	a)
US6703461052	NUCOR CORP	5'695	1'859	5'170	2'384 USD	197.90	424'944.50	0.05	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	12'166	0	392	11'774 USD	903.56	9'582'110.86	1.12	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	344	0	344	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	0	1'155	1'155	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	3'353	0	3'353	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6826801036	ONEOK INC	0	8'932	0	8'932 USD	80.17	644'971.85	0.08	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	3'552	0	3'552	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	0	1'394	1'394	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	2'301	2'301	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	6'084	0	3'195	2'889 USD	166.80	434'034.00	0.05	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3'953	0	3'953	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	6'452	832	0	7'284 USD	144.90	950'645.26	0.11	a)
US69370C1009	PTC INC	0	3'532	0	3'532 USD	188.94	601'069.61	0.07	a)
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	0	1'085	0	1'085 USD	189.78	185'464.31	0.02	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	2'130	1'108	3'238	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	4'911	0	4'911	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	2'786	0	927	1'859 USD	175.01	293'036.97	0.03	a)
US7170811035	PFIZER INC	41'789	0	41'789	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	0	6'233	6'233	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	694	0	694	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	14'370	3'296	7'951	9'715 USD	162.25	1'419'736.26	0.17	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8'223	0	0	8'223 USD	117.40	869'517.95	0.10	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	8'847	1'128	1'081	8'894 USD	120.62	966'265.81	0.11	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	8'461	2'784	1'491	9'754 USD	169.30	1'487'372.93	0.17	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	5'351	6'533	7'688	4'196 USD	133.11	503'067.57	0.06	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	1'425	0	124	1'301 USD	962.49	1'127'856.08	0.13	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	8'392	0	0	8'392 USD	21.04	159'034.51	0.02	a)
US7595091023	RELIANCE INC	2'686	0	2'686	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	5'639	0	5'639	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	500	0	500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	7'072	0	0	7'072 USD	301.18	1'918'441.43	0.22	a)
US8064071025	HENRY SCHEIN INC	0	1'370	1'370	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81762P1021	SERVICENOW INC	1'988	0	0	1'988 USD	762.40	1'365'147.04	0.16	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	3'216	0	3'216 USD	347.33	1'006'093.86	0.12	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	5'981	1'434	7'415	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	1'678	5'035	2'350	4'363 USD	125.87	494'638.15	0.06	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	2'776	0	0	2'776 USD	296.22	740'651.66	0.09	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.
US8574771031	STATE STREET CORP	11'604	0	0	11'604 USD	77.32	808'127.21	0.09	a)
US8636671013	STRYKER CORP	0	508	508	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'169	533	1'305	1'397 USD	571.50	719'105.82	0.08	a)
US8716581035	SYNCHRONY FINANCIAL	20'398	0	0	20'398 USD	43.12	792'221.28	0.09	a)
US8718291078	SYSCO CORP	12'138	0	3'847	8'291 USD	81.18	606'228.19	0.07	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	4'415	1'520	2'895 USD	163.22	425'600.48	0.05	a)
US88160R1014	TESLA INC	10'913	964	0	11'877 USD	175.79	1'880'533.55	0.22	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	471	0	0	471 USD	581.21	246'566.54	0.03	a)
US88579Y1010	3M CO	9'165	0	0	9'165 USD	106.07	875'598.89	0.10	a)
US89400J1079	TRANSUNION	4'268	0	4'268	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	0	9'762	0	9'762 USD	64.36	565'893.89	0.07	a)
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	19'279	6'139	25'418	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	23'574	0	7'394	16'180 USD	76.99	1'122'000.37	0.13	a)
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	11'464	0	11'464 USD	22.67	234'081.91	0.03	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	0	1'459	0	1'459 USD	522.88	687'127.75	0.08	a)
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	5'536	0	5'536 USD	245.93	1'226'274.66	0.14	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	1'857	0	260	1'597 USD	721.11	1'037'257.53	0.12	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	4'642	0	2'015	2'627 USD	494.70	1'170'528.91	0.14	a)
US9182041080	VF CORP	36'665	7'916	44'581	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	2'409	663	1'735	1'337 USD	222.83	268'339.89	0.03	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	2'634	0	2'634	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	0	1'387	0	1'387 USD	231.69	289'443.57	0.03	a)
US92338C1036	VERALTO CORP	0	3'415	0	3'415 USD	88.66	272'708.45	0.03	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	17'063	29'855	11'224	35'694 USD	41.96	1'348'996.62	0.16	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	3'528	0	3'528	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3'071	0	532	2'539 USD	418.01	955'937.58	0.11	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	4'931	0	4'931 USD	81.67	362'725.19	0.04	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	9'877	0	0	9'877 USD	279.08	2'482'755.38	0.29	a)
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	2'929	2'929	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	4'869	0	4'869 USD	145.68	638'880.85	0.07	a)
US9311421039	WALMART INC	3'692	6'204	3'692	6'204 USD	60.17	336'226.52	0.04	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	0	2'314	2'314	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	3'065	0	3'065 USD	317.53	876'587.77	0.10	a)
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	3'793	1'976	1'980	3'789 USD	272.75	930'828.19	0.11	a)
US98419M1009	XYLEM INC	7'359	0	7'359	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	9'304	0	9'304	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	6'924	0	6'924 USD	131.98	823'086.25	0.10	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	663	0	663	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	10'521	15'140	25'661	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	0	788	0	788 USD	192.63	136'719.45	0.02	a)

US

172'798'766.01 20.26

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

8'226'343.72 0.96

AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	820	0	820	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002829	1.7950 % BNP 1.795 09/03/27 ENTN	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	

AUD

0.00 0.00

CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA780086SY14	1.6700 % RY 1.67 01/28/33	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FA338	1.8880 % TD 1.888 03/08/28	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	

CAD

0.00 0.00

CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'000	0	1'000	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.
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'445	0	1'445	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	630	0	630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	2'000	0	2'000	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.
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'240	0	1'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	350	0	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1202242223	1.5203 % NWDIE 1.5203 12/17/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	545	0	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	1'000	0	1'000	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.
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	985	985	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CHF							0.00	0.00	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	8'000	2'000	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS1958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	9'500	0	9'500	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2223675146	3.5000 % QNBK 3 1/2 03/09/26 EMTN	0	5'000	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	2'500	0	2'500	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CNY							0.00	0.00	
BE0002923044	3.5000 % WALLOO 3 1/2 03/15/43 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTECOE0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	850	0	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2190201983	1.5000 % CROATI 1 1/2 06/17/31	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2293075680	1.5000 % ORSTED 1 1/2 02/18/3021	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	850	0	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	1'050	0	1'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	1'150	0	1'150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	1'650	0	1'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EUR							0.00	0.00	
FR0000486763	5.5000 % CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN	321	0	321	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	0	800	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	500	0	500	0 GBP	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.
GBP							0.00	0.00	
FR0014003L79	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2330256236	0.6330 % AFL 0.633 04/15/31	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2352398171	0.3000 % DNBNO 0.3 06/11/27 EMTN	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2387729408	0.4590 % HSBC 0.459 03/24/28 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JPY							0.00	0.00	
CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	900	0	0	900 USD	0.00%	0.00	0.00	d)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US038222AN54	1.7500 % AMAT 1 3/4 06/01/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05890PAB22	2.8750 % BCICI 2 7/8 10/14/31 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659X2K76	3.0520 % BNP 3.052 01/13/31 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122DQ80	1.4500 % BMY 1.45 11/13/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US370334CQ51	2.2500 % GIS 2 1/4 10/14/31	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAK17	4.0000 % HPQ 4 04/15/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076CJ91	1.8750 % HD 1 7/8 09/15/31	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836BX58	2.1000 % K 2.1 06/01/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BZ08	2.5000 % LLY 2 1/2 09/15/60	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CD48	2.6750 % MSFT 2.675 06/01/60	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63859VBF76	1.0000 % NWDI 1 08/28/25 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	200	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	2'000	500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	9'400	0	0	9'400 USD	97.16%	8'226'343.72	0.96	a)
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP2000TAA36	3.2500 % BANBRA 3 1/4 09/30/26 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU01386AF57	5.7500 % ALCSW 5 3/4 12/06/52 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD							8'226'343.72	0.96	

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.
Bezugsrechte							0.00	0.00	
CH1328441832	PROCIMMO REAL ESTATE SIC-RTS	0	7'083	7'083	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1329708742	SF RETAIL PROPERTIES - RTS	0	5'420	5'420	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	48'267	48'267	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	19'011	19'011	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							58'403'979.17	6.85	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INTERSWISS	11'289	0	1'500	9'789 CHF	179.00	1'752'231.00	0.21 a)	
CH0002770102	IMMO HELVETIC	8'900	0	0	8'900 CHF	216.00	1'922'400.00	0.23 a)	
CH0002782263	LA FONCIERE	13'367	0	2'500	10'867 CHF	136.50	1'483'345.50	0.17 a)	
CH0002785456	SOLVALOR 61	3'232	0	700	2'532 CHF	293.00	741'876.00	0.09 a)	
CH0009778769	IMMOFONDS	4'462	0	700	3'762 CHF	568.00	2'136'816.00	0.25 a)	
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	20'784	0	3'500	17'284 CHF	227.00	3'923'468.00	0.46 a)	
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	40'638	0	8'000	32'638 CHF	87.80	2'865'616.40	0.34 a)	
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	17'566	0	3'500	14'066 CHF	137.00	1'927'042.00	0.23 a)	
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	79'907	0	15'000	64'907 CHF	143.50	9'314'154.50	1.09 a)	
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	38'623	0	5'000	33'623 CHF	66.00	2'219'118.00	0.26 a)	
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	7'372	0	1'500	5'872 CHF	221.00	1'297'712.00	0.15 a)	
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND	6'039	0	1'000	5'039 CHF	194.00	977'566.00	0.11 a)	
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	29'500	0	10'000	19'500 CHF	19.90	388'050.00	0.05 a)	
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	7'350	0	1'500	5'850 CHF	149.00	871'650.00	0.10 a)	
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	22'747	0	5'000	17'747 CHF	148.00	2'626'556.00	0.31 a)	
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	7'083	0	0	7'083 CHF	146.00	1'034'118.00	0.12 a)	
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	4'904	0	1'366	3'538 CHF	173.00	612'074.00	0.07 a)	
CH0037430946	SWC (CH) REF RESPONSIBLE IFCA FA CHF	9'847	0	1'800	8'047 CHF	170.50	1'372'013.50	0.16 a)	
CH0039415010	REALSTONE SWISS PROPERTY	14'554	0	0	14'554 CHF	129.00	1'877'466.00	0.22 a)	
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	19'606	0	4'500	15'106 CHF	126.00	1'903'356.00	0.22 a)	
CH0111959190	SWC (CH) REF RESP SWISS COMMERCIAL FA CHF	5'534	0	0	5'534 CHF	103.50	572'769.00	0.07 a)	
CH0120791253	SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND	5'555	0	0	5'555 CHF	122.50	680'487.50	0.08 a)	
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	17'873	0	2'000	15'873 CHF	149.00	2'365'077.00	0.28 a)	
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	27'515	0	0	27'515 CHF	13.25	364'573.75	0.04 a)	
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A	7'306	0	0	7'306 CHF	104.00	759'824.00	0.09 a)	
CH0285087455	SF RET PROP FD / UT CHF	5'420	0	0	5'420 CHF	108.00	585'360.00	0.07 a)	
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	12'235	0	1'200	11'035 CHF	122.50	1'351'787.50	0.16 a)	
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	18'128	0	3'500	14'628 CHF	159.50	2'333'166.00	0.27 a)	
CH0414551033	BALOISE SWISS PROPERTY FD	3'632	0	0	3'632 CHF	119.00	432'208.00	0.05 a)	
CH							50'691'881.65	5.94	
IE00BYLVK39	UBS ETF BLOOMBERG COMMODITY CMCI H CHF	0	603'073	0	603'073 CHF	12.79	7'712'097.52	0.90 a)	
IE							7'712'097.52	0.90	

Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

403'105'582.47 47.27

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

403'105'582.47 47.27

CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	0	124'686	0	124'686 CHF	1'393.27	173'720'889.30	20.37 a)	
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	313'000	0	0	313'000 CHF	47.25	14'788'890.44	1.73 a)	
CH0388442359	SWC (CH) EF RESPONSIBLE SMC CH (II) NT CHF	245'884	7'220	0	253'104 CHF	124.14	31'419'777.61	3.68 a)	
CH0394628066	SWC (CH) MMF RESPONSIBLE OPPS CHF NT CHF	104'503	0	88'379	16'124 CHF	96.53	1'556'473.91	0.18 a)	
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	119'986	0	0	119'986 CHF	147.44	17'690'241.92	2.07 a)	
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS.GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	0	986'846	0	986'846 CHF	86.48	85'337'790.67	10.01 a)	
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	125'247	0	0	125'247 CHF	93.41	11'699'050.31	1.37 a)	
CH							336'213'114.16	39.43	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	25'796	0	0	25'796 USD	293.98	6'830'544.73	0.80 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.
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	159'394	0	0	159'394 USD	131.12	18'824'396.97	2.21	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	123'261	0	1'295	121'966 CHF	129.48	15'792'222.16	1.85	a)
LU2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPS NT	177'625	87'913	0	265'538 USD	106.39	25'445'304.45	2.98	a)
LU							66'892'468.31	7.84	

Derivative Finanzinstrumente

835'599.05 0.10

Futures

0.00 0.00

12/23	EURO-SCHATZ FUT DEC23	40	0	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	-50	50	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	-30	30	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	-360	360	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	219	219	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	-110	110	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	37	0	37	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	MSCI EMGMKT DEC23	80	0	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	43	16	59	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	-24	24	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	AUST 10Y BOND FUT DEC23	113	0	113	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	-50	50	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	BCOM COMDTY IND DEC23	802	0	802	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	-39	39	0	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	CAN 10YR BOND FUT DEC23	-101	201	100	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	50	0	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	HANG SENG IDX FUT FEB24	0	45	45	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NIKKEI 225 (SGX) MAR24	0	76	76	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-SCHATZ FUT MAR24	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	729	729	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	219	219	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	110	110	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	37	37	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	MSCI EMGMKT MAR24	0	262	262	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NASDAQ 100 E-MINI MAR24	0	53	53	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	24	24	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	E-MINI RUSS 2000 MAR24	0	90	90	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	AUST 10Y BOND FUT MAR24	0	113	113	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR ULTRA FUT MAR24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	BCOM COMDTY IND MAR24	0	802	802	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	39	39	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	HANG SENG IDX FUT MAR24	0	45	45	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	CAN 10YR BOND FUT MAR24	0	201	201	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 2YR NOTE (CBT) MAR24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/24	HANG SENG IDX FUT APR24	0	45	0	45 HKD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	NIKKEI 225 (SGX) JUN24	0	62	76	-14 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	BCOM COMDTY IND JUN24	0	802	0	802 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	0	171	-171 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	68	0	68 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	0	61	-61 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	1	0	1 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	MSCI EMGMKT JUN24	0	262	0	262 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NASDAQ 100 E-MINI JUN24	0	53	28	25 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	95	201	-106 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US 2YR NOTE (CBT) JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	

Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 02.11.2023	35'583'710	39'192'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 02.11.2023	85'372'000	7'324'320	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023	8'828'000	5'212'254	AUD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023	14'006'425	12'585'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023	4'598'905	6'799'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	29'903'566	30'986'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023	11'946'000	1'951'014'000	CHF/JPY	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.
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023		7'313'575	58'679'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.12.2023		3'171'055	527'845'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.12.2023		6'423'000	4'181'309		CAD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		34'889'692	38'805'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		35'686'591	37'249'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023		13'073'122	11'942'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.12.2023		8'954'000	5'135'379		AUD/CHF	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 04.12.2023		7'981'333	64'966'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		35'541'431	37'249'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		30'101'519	34'529'000		CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		13'195'349	11'942'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024		8'954'000	5'173'953		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024		6'423'000	4'117'869		CAD/CHF	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 04.01.2024		7'950'929	64'966'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.01.2024		10'523'622	1'768'055'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 02.02.2024		89'323'000	7'363'877		NOK/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		40'453'848	48'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024		11'104'371	1'865'237'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		13'395'679	12'540'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		26'772'916	28'829'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 02.02.2024		8'040'453	68'095'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.02.2024		6'923'000	4'385'402		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.02.2024		9'621'000	5'510'803		AUD/CHF	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 01.03.2024		4'158'300	6'480'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 01.03.2024		36'305'145	38'948'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.03.2024		51'564'519	59'893'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 01.03.2024		8'095'721	67'434'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 01.03.2024		92'522'000	7'602'348		NOK/CHF	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 01.03.2024		11'066'876	1'889'674'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 01.03.2024		13'670'641	12'521'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 01.03.2024		9'715'000	5'505'947		AUD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.04.2024		52'567'128	59'893'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 03.04.2024		11'058'807	1'889'674'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		37'041'067	38'948'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024		13'906'561	12'521'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 03.04.2024		8'219'598	67'434'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 03.04.2024		92'522'000	7'675'163		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.04.2024		9'715'000	5'551'549		AUD/CHF	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024		4'194'698	6'480'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/JPY	Verfall 03.04.2024		2'112'969'000	14'344'177		JPY/USD	0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 03.04.2024		14'237'837	2'112'969'000		USD/JPY	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.04.2024		32'810'000	29'538'056		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.04.2024		940'103'000	5'597'815		JPY/CHF	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024		1'717'601	1'508'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		18'104'000	17'697'529		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 03.04.2024		26'373'000	3'277'742		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.04.2024		3'203'000	2'125'719		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 02.05.2024		95'680'000	7'969'761		NOK/CHF	-48'653.10	-0.01	b)
CAD/CHF	Verfall 02.05.2024		2'116'494	3'188'000		CHF/CAD	1'440.47	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 02.05.2024		15'895'972	13'977'000		CHF/GBP	49'907.59	0.01	b)
USD/CHF	Verfall 02.05.2024		24'249'553	26'847'000		CHF/USD	158'406.15	0.02	b)
JPY/CHF	Verfall 02.05.2024		5'373'743	897'116'000		CHF/JPY	26'750.09	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 02.05.2024		21'521'827	22'083'000		CHF/EUR	91'205.66	0.01	b)
CHF/AUD	Verfall 02.05.2024		12'271'000	7'198'623		AUD/CHF	-8'063.62	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 06.05.2024		5'125'267	41'185'000		CHF/CNY	29'808.36	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							300'801.60	0.04	

Kreditderivate

12/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.39 12/27	-4'000	0	0	-4'000	USD	2.13	-76'798.96	-0.01	a)
-------	------------------------------------	--------	---	---	--------	-----	------	------------	-------	----

Swaps

04/33	IRS FIX LEG 1.8125% P.A. CHF	10'000	0	0	10'000	CHF	106.12%	10'611'596.41	1.24	b)
04/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-10'000	0	0	-10'000	CHF	100.00	-10'000'000.00	-1.17	b)

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht								18'001'572.11	2.11	
------------------------	--	--	--	--	--	--	--	---------------	------	--

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	358'892'351.04	42.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	8'226'343.72	0.96
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	461'509'561.64	54.12
Andere Anlagen - Metallkonten	3'791'478.05	0.44
Derivative Finanzinstrumente	835'599.05	0.10
Sonstige Vermögenswerte	1'519'841.49	0.18
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	852'776'747.10	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-903'978.79	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	851'872'768.31	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in %)
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);	828'551'457.44	97.16
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	912'398.01	0.11
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	35'165'857.09	4.12
------------------------------	----------------------	-------------

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte				29'318'471.52	3.44
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	284 EUR	833.70	230'319.20	0.03
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	13'737 USD	152.26	1'883'900.17	0.22
US1491231015	CATERPILLAR INC	4'379 USD	366.43	1'445'260.49	0.17
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	635 USD	732.63	419'023.70	0.05
US4612021034	INTUIT INC	2'565 USD	650.00	1'501'692.08	0.18
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	3'881 USD	481.57	1'683'384.13	0.20
US5949181045	MICROSOFT CORP	28'423 USD	420.72	10'770'682.79	1.26
US67066G1040	NVIDIA CORP	9'785 USD	903.56	7'963'390.07	0.93
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	6'419 USD	162.25	938'063.51	0.11
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	9'877 USD	279.08	2'482'755.38	0.29
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				2'275'371.67	0.27
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	2'600 USD	87.39%	2'275'371.67	0.27
Andere Wertpapiere				3'572'013.90	0.42
CH0002785456	SOLVALOR 61	2'532 CHF	293.00	741'876.00	0.09
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	19'251 CHF	19.90	383'094.90	0.04
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	5'850 CHF	149.00	871'650.00	0.10
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	689 CHF	173.00	119'197.00	0.01
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	7'252 CHF	149.00	1'080'548.00	0.13
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICPLUS-A	112 CHF	104.00	11'648.00	0.00
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	2'000 CHF	122.50	245'000.00	0.03
CH0414551033	BALOISE SWISS PROPERTY FD	1'000 CHF	119.00	119'000.00	0.01

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.58761668
CAD	1 = CHF	0.66558286
CNY	1 = CHF	0.12405653
CZK	100 = CHF	3.84700800
DKK	100 = CHF	13.04133800
EUR	1 = CHF	0.97275172
GBP	1 = CHF	1.13780928
HKD	100 = CHF	11.50841100
HUF	100 = CHF	0.24686700
JPY	100 = CHF	0.59513000
NOK	100 = CHF	8.30245400
NZD	1 = CHF	0.53875371
SEK	100 = CHF	8.42358300
SGD	1 = CHF	0.66738293
USD	1 = CHF	0.90070000
ZAR	1 = CHF	0.04756486

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
Bond	CHF	39'390'834.24	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	174'414'569.32	20.474
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	91'372'921.29	10.726
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

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
AA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	29'318'471.52
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	2'275'371.67
Andere Wertpapiere	CHF	3'572'013.90

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
AA CHF	1.350	2.000	1.100	0.250	4.000
CT CHF	0.730	1.300	0.480	0.250	4.000
GT CHF	0.550	1.000	0.430	0.120	4.000
NT CHF	-	-	-	-	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.

0) 14.03.2024 - 31.03.2024

9 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

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 Bewertungs-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.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-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.
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 Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-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.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).
Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen.

Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des jeweiligen Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des jeweiligen Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem

Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. 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) 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.