

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE SELECT

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	237926	CHF
CT CHF	37873487	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	24
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	24
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	24
8	Pauschale Verwaltungskommission	25
9	Benchmark	25
10	TER	25
11	Fussnoten	26
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	27

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		817'194'017.16	789'608'906.20	820'985'816.20	1'052'557'191.20
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'784'766.260	-	-	-
Klasse AA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		804'233'661.62	776'133'899.32	806'248'546.40	1'032'466'299.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		660'400.487	676'299.286	716'889.757	783'660.118
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'217.7969	1'147.6190	1'124.6479	1'317.4900
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'220.1107	1'145.3237	1'122.5111	1'318.2800
Ausschüttung je Anteil		-	6.85	5.15	3.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.26 %	1.26 %	1.26 %	1.29 %
Klasse CT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'960'355.54	13'475'006.88	14'737'269.80	20'090'891.92
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		124'043.837	137'491.919	154'413.675	180'611.555
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		104.4821	98.0058	95.4402	111.2400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		104.6806	97.8098	95.2589	111.3000
Thesaurierung je Anteil		-	1.12	1.01	0.85
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.71 %	0.71 %	0.71 %	0.74 %

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

Performance

	2022 / 2023	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	7.15 %	3.88 %	-14.33 %	2.97 %
Klasse CT CHF	7.45 %	4.45 %	-13.86 %	3.54 %

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	17'974'387.19	9'355'069.25
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	222'188'955.99	202'093'253.83
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	0.00	409'710'788.93
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	572'098'333.00	165'724'975.31
Andere Anlagen - Metallkonten	3'837'350.75	1'711.13
Derivative Finanzinstrumente	688'519.19	-438'541.20
Sonstige Vermögenswerte	1'185'815.97	3'931'944.13
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	817'973'362.09	790'379'201.38
Andere Verbindlichkeiten	-779'344.93	-770'295.18
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	817'194'017.16	789'608'906.20

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		676'299.286	716'889.757
Ausgegebene Anteile		20'670.459	35'522.726
Zurückgenommene Anteile		-36'569.258	-76'113.197
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		660'400.487	676'299.286

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		137'491.919	154'413.675
Ausgegebene Anteile		1'865.804	12'944.908
Zurückgenommene Anteile		-15'313.886	-29'866.664
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		124'043.837	137'491.919

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		789'608'906.20	820'985'816.20
Ausbezahlte Ausschüttung		-4'552'764.88	-3'581'898.29
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-50'349.35	-54'707.36
Saldo aus dem Anteilverkehr		-19'871'342.87	-48'350'171.58
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		52'059'568.06	20'609'867.23
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		817'194'017.16	789'608'906.20

Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		132'008.06	161'666.05
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-637.26	-4'313.54
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'951'781.76	4'574'848.02
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'698'146.52	5'877'864.07
Erträge der Gratisaktien		3'758.88	237.96
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'004'995.98	3'725'807.60
Erträge aus Wertpapierleihe		64'215.10	193'552.10
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		6'654.28	68'366.81
Total Ertrag		5'860'923.32	14'598'029.07
Aufwand			
Passivzinsen		-13.63	-313.70
Reglementarische Vergütungen		-4'665'537.70	-9'648'606.95
Sonstige Aufwendungen		-2'479.03	1'175.16
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-11'455.88	-145'769.10
Total Aufwand		-4'679'486.24	-9'793'514.59
Nettoertrag / Verlust		1'181'437.08	4'804'514.48
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-60'505'920.94	-13'989'192.28
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		23'475.32	281'162.48
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		74'353.70	142'974.84
Realisierter Erfolg		-59'226'654.84	-8'760'540.48
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		111'286'222.90	29'370'407.71
Gesamterfolg		52'059'568.06	20'609'867.23

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							288'426'619.17	35.26	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							222'188'955.99	27.16	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	259	222	259	222 USD	1'511.96	302'324.57	0.04	a)
AR							302'324.57	0.04	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	3'157	0	0	3'157 EUR	41.30	126'831.36	0.02	a)
AT							126'831.36	0.02	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	16'912	0	0	16'912 AUD	43.00	427'324.25	0.05	a)
AU000000ANZ3	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	0	2'755	0	2'755 AUD	29.40	47'595.19	0.01	a)
AU000000APA1	APA GROUP	25'286	0	25'286	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	0	33'455	0	33'455 AUD	25.70	505'229.00	0.06	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	63'234	69'466	132'700	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	22'001	92'247	114'248	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	52'639	0	10'835	41'804 AUD	18.13	445'358.51	0.05	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	104'359	0	104'359 AUD	3.39	207'885.27	0.03	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	7'315	3'619	10'934	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	25'960	0	25'960	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	0	106'219	0	106'219 AUD	2.13	132'946.20	0.02	a)
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	68'531	41'972	0	110'503 AUD	5.51	357'783.07	0.04	a)
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	21'918	21'571	21'918	21'571 AUD	30.50	386'602.12	0.05	a)
AU							2'510'723.61	0.31	
BE0003565737	KBC GROUP NV	4'413	1'225	0	5'638 EUR	69.42	380'725.26	0.05	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2'310	0	2'310	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE							380'725.26	0.05	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	80'684	0	80'684 USD	6.10	443'443.06	0.05	a)
BM							443'443.06	0.05	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	4'541	28'526	4'541	28'526 CAD	24.15	458'521.96	0.06	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	24'234	0	24'234	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	0	5'123	0	5'123 CAD	77.31	263'610.17	0.03	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	15'380	0	15'380 CAD	29.92	306'281.00	0.04	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	7'333	0	7'333 CAD	56.90	277'712.92	0.03	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	0	17'738	9'122	8'616 CAD	68.67	393'799.23	0.05	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13'843	3'698	13'843	3'698 CAD	30.85	75'931.89	0.01	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	1'838	2'143	3'981	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	6'189	0	6'189	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	10'382	0	10'382 CAD	8.31	57'422.78	0.01	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	4'315	0	4'315 CAD	150.10	431'085.71	0.05	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	29'215	0	0	29'215 CAD	33.83	657'824.46	0.08	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	6'258	0	6'258	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	22'734	0	0	22'734 CAD	22.13	334'857.01	0.04	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	3'289	7'374	5'732	4'931 CAD	73.59	241'521.58	0.03	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2'538	0	2'538	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	9'484	0	9'484	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA70137W1086	PARKLAND CORP	5'990	1'912	7'902	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	14'668	0	14'668 CAD	47.81	466'758.00	0.06	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	6'277	10'755	0	17'032 CAD	37.98	430'549.15	0.05	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	3'334	3'334	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	0	1'997	1'997	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	5'369	5'369	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	6'060	6'013	6'060	6'013 CAD	73.91	295'798.89	0.04	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	16'599	0	16'599	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	2'892	7'717	10'609	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA							4'691'674.75	0.57	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	2'043	1'013	0	3'056 CHF	551.40	1'685'078.40	0.21	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.
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	677	120	254	543 CHF	4'016.00	2'180'688.00	0.27	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12'374	70	0	12'444 CHF	486.30	6'051'517.20	0.74	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	130'750	2'764	2'392	131'122 CHF	87.37	11'456'129.14	1.40	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	51'080	1'199	2'021	50'258 CHF	229.70	11'544'262.60	1.41	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	25'409	0	3'399	22'010 CHF	81.66	1'797'336.60	0.22	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	90'629	518	5'203	85'944 CHF	41.89	3'600'194.16	0.44	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	3'319	1'281	475	4'125 CHF	261.10	1'077'037.50	0.13	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	7'960	787	1'556	7'191 CHF	540.20	3'884'578.20	0.47	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3'743	21	0	3'764 CHF	632.20	2'379'600.80	0.29	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2'239	13	41	2'211 CHF	1'288.00	2'847'768.00	0.35	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	4'363	0	4'363 CHF	251.00	1'095'113.00	0.13	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	1'094	179	245	1'028 CHF	533.00	547'924.00	0.07	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	195'523	1'241	7'574	189'190 CHF	95.75	18'114'942.50	2.21	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	7'936	0	917	7'019 CHF	115.95	813'853.05	0.10	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	39'148	5'652	3'913	40'887 CHF	137.50	5'621'962.50	0.69	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	204'392	1'156	9'199	196'349 CHF	27.74	5'446'721.26	0.67	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	7'061	1'831	0	8'892 CHF	268.60	2'388'391.20	0.29	a)
CH0432492467	ALCON INC	57'504	0	5'322	52'182 CHF	74.74	3'900'082.68	0.48	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	699	699	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	26'150	26'150	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH							86'433'180.79	10.57	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22'414	7'672	8'621	21'465 EUR	14.58	304'473.85	0.04	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	2'928	0	2'928 EUR	66.90	190'545.72	0.02	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	6'331	5'945	6'331	5'945 EUR	74.50	430'834.17	0.05	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	1'947	0	1'947	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	5'234	5'847	11'081	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	3'128	2'073	1'372	3'829 EUR	180.46	672'153.29	0.08	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	4'965	0	531	4'434 EUR	176.96	763'260.53	0.09	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	1'856	0	1'856 EUR	277.80	501'547.67	0.06	a)
DE000A1EWWWO	ADIDAS AG	2'498	0	2'498	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	29'588	0	0	29'588 EUR	12.89	370'853.21	0.05	a)
DE							3'233'668.44	0.40	
DK0010181759	CARLSBERG A/S-B	0	396	396	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	3'566	0	0	3'566 DKK	1'114.50	518'302.81	0.06	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	2'411	3'876	6'287	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	9'438	2'938	4'006	8'370 DKK	881.30	961'991.82	0.12	a)
DK							1'480'294.63	0.18	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	5'223	0	5'223	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	27'813	0	11'510	16'303 EUR	11.04	175'080.84	0.02	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	1'118	3'266	686	3'698 EUR	112.85	405'948.07	0.05	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	8'628	0	8'628	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	24'098	0	24'098 EUR	15.81	370'490.87	0.05	a)
ES							951'519.78	0.12	
FI0009007884	ELISA OYJ	3'729	5'052	0	8'781 EUR	41.35	353'200.65	0.04	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	3'672	0	3'672	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	14'154	0	14'154	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
FI							353'200.65	0.04	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	31'357	0	31'357 EUR	13.82	421'423.58	0.05	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	3'849	6'943	3'832	6'960 EUR	63.47	429'714.24	0.05	a)
FR0000120578	SANOFI	3'320	0	3'320	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	20'847	5'455	8'995	17'307 EUR	34.82	586'124.94	0.07	a)
FR0000120644	DANONE	8'568	0	0	8'568 EUR	59.89	499'155.41	0.06	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	294	0	115	179 EUR	833.70	145'165.98	0.02	a)
FR0000121220	SODEXO SA	1'241	0	1'241	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	1'053	1'053	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	6'686	0	0	6'686 EUR	24.00	156'091.63	0.02	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1'775	3'105	1'775	3'105 EUR	209.65	633'225.62	0.08	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8'297	0	8'297	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	4'366	0	3'040	1'326 EUR	101.05	130'341.24	0.02	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	14'695	3'904	18'599	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	8'425	0	0	8'425 EUR	65.86	539'751.23	0.07	a)
FR0010208488	ENGIE	9'943	16'912	0	26'855 EUR	15.51	405'171.57	0.05	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	4'879	0	4'879	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	7'128	12'966	20'094	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	7'088	0	7'088 EUR	41.04	282'965.23	0.03	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	14'384	0	14'384 EUR	35.52	496'998.00	0.06	a)
FR							4'726'128.67	0.58	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	4'817	0	1'951	2'866 AUD	121.76	205'057.16	0.03	a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	15'072	48'709	0	63'781 GBP	671.40	487'239.10	0.06	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	100'240	0	56'821	43'419 GBP	619.00	305'801.73	0.04	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	36'193	0	36'193 GBP	1'042.00	429'103.22	0.05	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	5'997	0	5'997 GBP	5'017.00	342'332.10	0.04	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	1'406	0	0	1'406 GBP	10'678.00	170'822.36	0.02	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	147'263	0	100'310	46'953 GBP	183.20	97'871.96	0.01	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	12'717	16'339	0	29'056 GBP	1'213.00	401'020.06	0.05	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	64'719	0	64'719 GBP	270.40	199'116.83	0.02	a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	271'437	43'605	63'425	251'617 GBP	127.65	365'451.94	0.04	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	8'266	3'171	11'437	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	0	1'378	1'378	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	17'999	0	17'999	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	14'192	0	0	14'192 GBP	3'424.00	552'900.31	0.07	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	9'994	0	9'994	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	2'788	0	2'788	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2'382	0	0	2'382 USD	69.95	150'075.44	0.02	a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	515'829	0	515'829	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	25'686	0	25'686 GBP	220.50	64'442.82	0.01	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	141'975	0	0	141'975 GBP	296.60	479'129.04	0.06	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	102'815	102'815	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	38'945	0	38'945 GBP	831.20	368'321.20	0.05	a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	8'089	3'853	0	11'942 GBP	1'708.60	232'159.75	0.03	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	32'893	8'939	23'966	17'866 GBP	2'625.00	533'612.64	0.07	a)
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	24'317	0	24'317 GBP	700.20	193'732.09	0.02	a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	21'782	0	21'782 GBP	658.20	163'126.72	0.02	a)
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	6'766	0	0	6'766 USD	85.44	520'683.00	0.06	a)
JE00BJN4441	CLARIVATE PLC	0	11'556	11'556	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	3'185	0	0	3'185 GBP	17'291.11	626'616.59	0.08	a)
GB							6'888'616.06	0.84	
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	62'000	0	62'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	257'000	169'000	426'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	6'300	0	6'300 HKD	85.65	62'098.81	0.01	a)
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	79'000	79'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0823032773	LINK REIT	47'000	22'200	47'000	22'200 HKD	33.65	85'971.28	0.01	a)
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	168'500	13'000	0	181'500 HKD	20.95	437'598.70	0.05	a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	0	61'500	61'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	88'200	88'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	23'000	0	23'000 HKD	25.45	67'364.48	0.01	a)
HK							653'033.27	0.08	
CRH ID	CRH PLC	6'378	0	6'378	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE0001827041	CRH PLC	0	6'378	0	6'378 GBP	6'828.00	495'504.38	0.06	a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	3'697	0	3'697 EUR	42.27	152'014.04	0.02	a)
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	1'391	1'746	438	2'699 USD	346.61	842'605.20	0.10	a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	878	0	878	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	38'878	6'594	45'472	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	2'064	0	2'064 USD	300.20	558'085.25	0.07	a)
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	7'312	7'312	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE							2'048'208.87	0.25	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	1'035	0	0	1'035 USD	164.01	152'894.14	0.02	a)
IL							152'894.14	0.02	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	26'987	1'589	7'708	20'868 EUR	23.46	476'223.52	0.06	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	139'754	0	0	139'754 EUR	3.36	457'186.21	0.06	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	11'951	11'951	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	18'646	0	0	18'646 EUR	11.61	210'490.66	0.03	a)
IT							1'143'900.39	0.14	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	120'358	0	120'358	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	13'293	0	13'293	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	3'938	0	0	3'938 EUR	145.20	556'217.10	0.07	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	2'761	0	0	2'761 USD	247.77	616'162.54	0.08	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	385	0	0	385 EUR	892.20	334'137.30	0.04	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	102	0	102	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6'166	0	6'166	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011821202	ING GROEP NV	0	6'471	0	6'471 EUR	15.25	95'968.64	0.01	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	2'472	5'195	2'472	5'195 EUR	69.18	349'597.34	0.04	a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	6'471	6'471	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							1'952'082.92	0.24	
NO0010096985	EQUINOR ASA	9'178	0	9'178	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	10'593	0	10'593 NOK	269.80	237'283.42	0.03	a)
NO							237'283.42	0.03	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	2'390	1'323	0	3'713 NZD	34.25	68'513.44	0.01	a)
NZ							68'513.44	0.01	
PTEDPOAM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	0	10'557	0	10'557 EUR	3.61	37'072.32	0.00	a)
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	7'970	0	7'970	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PT							37'072.32	0.00	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28'157	0	7'807	20'350 SEK	174.58	299'264.89	0.04	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	24'840	0	3'945	20'895 SEK	290.10	510'607.23	0.06	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	8'297	6'546	14'843	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	19'993	19'993	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	12'230	0	12'230 SEK	307.10	316'375.71	0.04	a)
SE							1'126'247.83	0.14	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	25'642	0	25'642	0 USD	0.00	0.00	0.00	
SG1S04926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	59'500	0	13'200	46'300 SGD	13.49	416'838.70	0.05	a)
SG							416'838.70	0.05	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	6'966	0	6'966 USD	54.81	343'893.08	0.04	a)
BMG491BT1088	INVESCO LTD	23'700	6'574	30'274	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	2'575	0	2'575	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059Y5762	LINDE PLC	658	0	320	338 USD	464.32	141'356.00	0.02	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	3'126	0	2'681	445 USD	312.68	125'325.74	0.02	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8'995	0	8'995	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	771	0	771 USD	86.91	60'353.75	0.01	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	1'729	1'729	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	35'406	7'340	30'423	12'323 USD	17.60	195'348.14	0.02	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	3'158	0	2'448	710 USD	113.66	72'685.23	0.01	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	2'085	3'152	0	5'237 USD	182.10	858'959.49	0.11	a)
US00724F1012	ADOBE INC	2'006	279	215	2'070 USD	504.60	940'800.97	0.12	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	2'510	765	0	3'275 USD	180.49	532'408.05	0.07	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	946	0	946 USD	108.76	92'670.28	0.01	a)
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	17'062	0	17'062	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	9'898	4'039	6'440	7'497 USD	152.26	1'028'142.94	0.13	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	23'189	4'305	5'365	22'129 USD	150.93	3'008'274.92	0.37	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	2'972	0	2'972	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0231351067	AMAZON.COM INC	25'332	848	0	26'180 USD	180.38	4'253'419.20	0.52	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	4'034	0	0	4'034 USD	227.69	827'294.27	0.10	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	3'416	2'654	3'416	2'654 USD	197.59	472'330.56	0.06	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	1'837	487	2'324	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	0	989	0	989 USD	438.44	390'558.98	0.05	a)
US0311621009	AMGEN INC	2'088	896	0	2'984 USD	284.32	764'163.68	0.09	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	0	14'889	14'889	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	1'451	0	1'451	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	924	594	0	1'518 USD	518.54	708'980.35	0.09	a)
US0378331005	APPLE INC	42'176	0	7'679	34'497 USD	171.48	5'328'131.89	0.65	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.
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	0	4'197	0	4'197 USD	206.23	779'598.46	0.10	a)
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	3'567	3'567	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	224	1'984	0	2'208 USD	260.42	517'909.13	0.06	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	455	2'442	0	2'897 USD	249.74	651'653.55	0.08	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	28	19	47	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	871	871	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	5'962	0	0	5'962 USD	37.92	203'629.39	0.02	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	12'206	0	0	12'206 USD	57.62	633'471.06	0.08	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	1'867	0	1'867	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	246	0	25	221 USD	3'627.88	722'146.57	0.09	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	4'215	0	4'215	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	5'975	938	5'037 USD	65.31	296'300.10	0.04	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	11'691	2'341	0	14'032 USD	54.23	685'392.49	0.08	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	2'287	324	0	2'611 USD	204.86	481'774.94	0.06	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	929	343	369	903 USD	1'325.41	1'077'998.50	0.13	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0	1'441	1'441	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	2'275	1'210	1'730	1'755 USD	208.55	329'660.93	0.04	a)
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0	1'293	1'293	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	0	2'529	459	2'070 USD	363.19	677'149.23	0.08	a)
US1264081035	CSX CORP	0	6'542	0	6'542 USD	37.07	218'430.50	0.03	a)
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	14'177	3'485	17'662	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	2'504	0	2'504	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	9'618	0	9'618	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1'687	2'476	0	4'163 USD	148.89	558'280.04	0.07	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	4'496	3'420	3'108	4'808 USD	111.90	484'590.29	0.06	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	1'754	834	0	2'588 USD	366.43	854'152.58	0.10	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	0	1'726	0	1'726 USD	78.48	122'005.65	0.01	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	885	488	1'373	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	3'360	3'360	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	7'155	1'355	6'529	1'981 USD	157.74	281'453.38	0.03	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	215	0	73	142 USD	2'906.77	371'774.14	0.05	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	4'926	4'784	4'926	4'784 USD	104.31	449'466.45	0.05	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	17'808	917	0	18'725 USD	49.91	841'762.47	0.10	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	929	0	929 USD	687.03	574'872.56	0.07	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	0	8'870	0	8'870 USD	63.24	505'237.58	0.06	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	2'652	2'652	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	17'943	3'011	14'638	6'316 USD	61.18	348'042.08	0.04	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	676	0	676 USD	73.29	44'624.32	0.01	a)
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	0	7'054	0	7'054 USD	90.05	572'136.08	0.07	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	19'053	2'144	0	21'197 USD	43.35	827'644.18	0.10	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	6'645	0	6'645	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	5'489	0	0	5'489 USD	90.81	448'959.40	0.05	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	0	5'063	0	5'063 USD	57.67	262'989.28	0.03	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	403	0	0	403 USD	732.63	265'931.58	0.03	a)
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	5'010	2'937	5'266	2'681 USD	105.83	255'555.82	0.03	a)
US2358511028	DANAHER CORP	338	0	338	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	3'307	358	3'307	358 USD	167.15	53'897.62	0.01	a)
US23918K1088	DAVITA INC	1'913	2'039	2'995	957 USD	138.05	118'994.94	0.01	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	735	0	667	68 USD	941.26	57'649.92	0.01	a)
US2441991054	DEERE & CO	0	491	0	491 USD	410.74	181'647.18	0.02	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	1'989	0	1'989	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	11'434	0	11'434 USD	50.18	516'783.94	0.06	a)
US2521311074	DEXCOM INC	1'323	0	1'323	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	4'817	2'115	2'702 USD	198.17	482'284.62	0.06	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5'039	0	2'601	2'438 USD	131.09	287'861.40	0.04	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	1'033	0	1'033 USD	59.55	55'406.70	0.01	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	129	0	129 USD	496.88	57'732.64	0.01	a)
US2605571031	DOW INC	9'600	0	9'600	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	6'508	0	0	6'508 USD	24.30	142'440.66	0.02	a)
US2786421030	EBAY INC	6'552	4'363	0	10'915 USD	52.78	518'887.60	0.06	a)
US2788651006	ECOLAB INC	3'279	0	3'279	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.
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6'490	0	2'201	4'289 USD	95.56	369'158.06	0.05	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	0	4'454	0	4'454 USD	132.67	532'234.60	0.07	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	6'012	4'796	6'012	4'796 USD	113.42	489'946.86	0.06	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	470	0	470 USD	120.98	51'214.34	0.01	a)
US29444U7000	EQUINIX INC	734	606	734	606 USD	825.33	450'485.09	0.06	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	5'495	7'774	0	13'269 USD	38.01	454'272.27	0.06	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	0	7'631	7'631	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	7'761	0	7'761	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	7'603	0	1'323	6'280 USD	116.24	657'499.47	0.08	a)
US3024913036	FMC CORP	6'455	4'595	9'917	1'133 USD	63.70	65'005.41	0.01	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	4'317	347	0	4'664 USD	485.58	2'039'855.93	0.25	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	1'427	0	1'427	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3156161024	F5 INC	0	266	0	266 USD	189.59	45'423.15	0.01	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	9'247	2'715	7'662	4'300 USD	74.18	287'299.88	0.04	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	10'745	0	10'745	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	2'996	0	2'996	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	6'607	1'863	6'607	1'863 USD	86.02	144'341.91	0.02	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	0	6'134	0	6'134 USD	84.67	467'792.76	0.06	a)
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	3'169	3'169	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	3'450	10'077	0	13'527 USD	28.62	348'699.47	0.04	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	3'543	3'543	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	7'379	713	0	8'092 USD	69.97	509'973.85	0.06	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	1'423	1'092	2'515	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	8'469	1'053	0	9'522 USD	73.25	628'226.09	0.08	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	0	1'887	0	1'887 USD	417.69	709'914.65	0.09	a)
US3841091040	GRACO INC	3'625	0	3'625	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	VWV GRAINGER INC	649	0	649	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	1'861	0	1'861	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	6'205	0	6'205 USD	103.05	575'930.32	0.07	a)
US4180561072	HASBRO INC	0	12'362	3'221	9'141 USD	56.52	465'346.04	0.06	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	0	1'740	1'740	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0	660	0	660 USD	213.31	126'804.69	0.02	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	5'709	0	5'709	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	1'211	2'500	0	3'711 USD	383.60	1'282'182.12	0.16	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	0	24'621	0	24'621 USD	20.68	458'602.47	0.06	a)
US4435106079	HUBBELL INC	1'240	0	0	1'240 USD	415.05	463'556.06	0.06	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	193	0	193	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	0	1'442	0	1'442 USD	346.72	450'323.20	0.06	a)
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	0	43'577	43'577	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	0	878	0	878 USD	137.32	108'594.66	0.01	a)
US45337C1027	INCYTE CORP	7'007	0	0	7'007 USD	56.97	359'549.34	0.04	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	5'113	0	5'113 USD	94.95	437'271.25	0.05	a)
US45784P1012	INSULET CORP	0	1'127	0	1'127 USD	171.40	173'986.24	0.02	a)
US4581401001	INTEL CORP	0	10'081	4'263	5'818 USD	44.17	231'462.84	0.03	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	4'003	650	0	4'653 USD	190.96	800'305.17	0.10	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	8'181	5'089	0	13'270 USD	39.02	466'378.32	0.06	a)
US4612021034	INTUIT INC	1'559	0	172	1'387 USD	650.00	812'026.09	0.10	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	987	369	987	369 USD	399.09	132'640.87	0.02	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	6'165	2'216	5'653	2'728 USD	80.21	197'084.76	0.02	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	7'539	0	1'154	6'385 USD	200.30	1'151'919.19	0.14	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	4'114	5'009	0	9'123 USD	158.19	1'299'860.85	0.16	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	4'840	5'411	4'840	5'411 USD	37.06	180'618.87	0.02	a)
US4878361082	KELLANOVA	7'122	4'893	2'973	9'042 USD	57.29	466'577.17	0.06	a)
US49177J1025	KENVUE INC	0	7'983	7'983	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	14'618	14'618	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	20'558	0	20'558 USD	15.81	292'747.30	0.04	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3'370	390	3'370	390 USD	156.38	54'932.07	0.01	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	3'692	734	0	4'426 USD	129.35	515'653.54	0.06	a)
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	0	53'517	24'771	28'746 USD	18.34	474'850.52	0.06	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	12'758	0	12'758 USD	36.90	424'022.72	0.05	a)
US5018892084	LKQ CORP	0	9'849	9'849	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	3'008	541	2'467 USD	218.46	485'424.00	0.06	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	927	0	157	770 USD	971.57	673'821.69	0.08	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	2'772	0	771	2'001 USD	777.96	1'402'117.85	0.17	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	2'023	1'359	2'023	1'359 USD	254.73	311'802.59	0.04	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	10'158	63'650	73'808	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	12'094	5'866	0	17'960 USD	28.34	458'444.05	0.06	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	2'537	1'015	1'150	2'402 USD	201.50	435'941.50	0.05	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	3'298	0	989	2'309 USD	481.57	1'001'528.98	0.12	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	552	0	0	552 USD	281.95	140'181.71	0.02	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	525	1'055	1'580	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	10'192	348	0	10'540 USD	131.95	1'252'651.23	0.15	a)
US59156R1086	METLIFE INC	0	7'746	0	7'746 USD	74.11	517'052.29	0.06	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	19'763	261	1'171	18'853 USD	420.72	7'144'203.03	0.87	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3'276	0	3'276	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	2'931	0	2'931	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0	3'274	3'274	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6'969	0	0	6'969 USD	67.25	422'126.79	0.05	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	0	6'086	0	6'086 USD	70.00	383'716.21	0.05	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	3'477	5'004	8'481	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	813	2'679	0	3'492 USD	104.97	330'156.30	0.04	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	199	591	267	523 USD	607.33	286'092.57	0.03	a)
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	453	0	453 USD	137.92	56'273.72	0.01	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	9'160	0	9'160	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELock INC	0	5'613	0	5'613 USD	22.40	113'246.09	0.01	a)
US6703461052	NUCOR CORP	3'300	1'380	3'322	1'358 USD	197.90	242'061.50	0.03	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	7'379	0	586	6'793 USD	903.56	5'528'391.29	0.68	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	211	0	211	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	0	539	539	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	2'117	0	2'117	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6826801036	ONEOK INC	0	5'417	0	5'417 USD	80.17	391'156.80	0.05	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	2'115	0	2'115	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	3'495	0	1'797	1'698 USD	166.80	255'102.02	0.03	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2'416	0	2'416	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	4'104	370	0	4'474 USD	144.90	583'908.14	0.07	a)
US69370C1009	PTC INC	0	2'106	0	2'106 USD	188.94	358'395.41	0.04	a)
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	0	748	0	748 USD	189.78	127'859.26	0.02	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	1'289	586	1'875	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	2'842	0	2'842	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	1'708	0	550	1'158 USD	175.01	182'537.29	0.02	a)
US7170811035	PFIZER INC	25'700	0	25'700	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	0	3'560	3'560	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	469	0	469	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	8'578	1'959	4'786	5'751 USD	162.25	840'442.94	0.10	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5'110	0	0	5'110 USD	117.40	540'342.54	0.07	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	5'288	0	0	5'288 USD	120.62	574'501.19	0.07	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	5'159	2'080	1'571	5'668 USD	169.30	864'304.87	0.11	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	3'302	3'883	4'702	2'483 USD	133.11	297'692.28	0.04	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	837	0	111	726 USD	962.49	629'380.10	0.08	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	5'082	0	0	5'082 USD	21.04	96'307.60	0.01	a)
US7595091023	RELIANCE INC	1'844	0	1'844	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US76954A1034	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	0	3'640	0	3'640 USD	10.95	35'900.10	0.00	a)
US7703231032	ROBERT HALF INC	3'463	0	3'463	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	307	0	307	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	4'296	0	0	4'296 USD	301.18	1'165'388.06	0.14	a)
US81762P1021	SERVICENOW INC	1'250	53	171	1'132 USD	762.40	777'337.25	0.10	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	1'890	0	1'890 USD	347.33	591'267.85	0.07	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	3'592	715	4'307	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	1'065	2'342	1'340	2'067 USD	125.87	234'338.08	0.03	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	1'653	0	0	1'653 USD	296.22	441'029.25	0.05	a)
US8574771031	STATE STREET CORP	6'478	0	0	6'478 USD	77.32	451'141.68	0.06	a)
US8636671013	STRYKER CORP	0	294	294	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.
US8716071076	SYNOPSIS INC	1'304	318	795	827 USD	571.50	425'698.29	0.05	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	12'697	0	0	12'697 USD	43.12	493'128.42	0.06	a)
US8718291078	SYSCO CORP	7'330	0	2'368	4'962 USD	81.18	362'815.61	0.04	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	2'583	815	1'768 USD	163.22	259'917.67	0.03	a)
US88160R1014	TESLA INC	6'830	516	351	6'995 USD	175.79	1'107'546.70	0.14	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	226	0	0	226 USD	581.21	118'310.06	0.01	a)
US88579Y1010	3M CO	5'268	169	0	5'437 USD	106.07	519'436.02	0.06	a)
US89400J1079	TRANSUNION	2'635	0	2'635	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	0	5'764	0	5'764 USD	64.36	334'133.62	0.04	a)
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	11'424	3'936	15'360	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	14'317	0	4'791	9'526 USD	76.99	660'579.45	0.08	a)
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	6'801	0	6'801 USD	22.67	138'868.73	0.02	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	0	862	0	862 USD	522.88	405'965.81	0.05	a)
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	3'246	0	3'246 USD	245.93	719'018.70	0.09	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	1'166	0	191	975 USD	721.11	633'266.18	0.08	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	2'751	0	1'214	1'537 USD	494.70	684'850.76	0.08	a)
US9182041080	VF CORP	21'791	4'833	26'624	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	1'518	329	1'043	804 USD	222.83	161'365.20	0.02	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	1'678	0	1'678	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	0	835	0	835 USD	231.69	174'250.46	0.02	a)
US92338C1036	VERALTO CORP	0	2'007	0	2'007 USD	88.66	160'271.12	0.02	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	10'452	19'361	7'785	22'028 USD	41.96	832'512.40	0.10	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	2'037	0	2'037	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1'801	0	297	1'504 USD	418.01	566'258.42	0.07	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	2'894	0	2'894 USD	81.67	212'883.13	0.03	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	6'040	0	394	5'646 USD	279.08	1'419'220.09	0.17	a)
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	1'780	1'780	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	2'824	0	2'824 USD	145.68	370'548.27	0.05	a)
US9311421039	WALMART INC	2'228	3'504	2'228	3'504 USD	60.17	189'899.70	0.02	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	0	1'242	1'242	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	1'803	0	1'803 USD	317.53	515'656.69	0.06	a)
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	2'426	1'117	1'297	2'246 USD	272.75	551'765.67	0.07	a)
US98419M1009	XYLEM INC	4'257	0	4'257	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	5'646	0	5'646	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	4'104	0	4'104 USD	131.98	487'860.48	0.06	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	464	0	464	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	6'150	15'567	21'717	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	0	479	0	479 USD	192.63	83'107.38	0.01	a)

US

101'830'549.06 12.45

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	1'000	0	1'000	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	
AU3CB0278554	1.5000 % TD 1 1/2 03/17/26	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	2'500	0	2'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	1'450	0	1'450	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	

AUD

0.00 0.00

CA404280BE83	3.1960 % HSBC 3.196 12/05/23 MPLE	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA563469UF02	2.8500 % MP 2.85 09/05/46	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAL19	1.9000 % ONT 1.9 12/02/51	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	

CAD

0.00 0.00

CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132163434	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 06/30/31	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228531437	2.3750 % KWLILJ 2 3/8 12/10/26	1'500	0	1'500	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.
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	200	0	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	
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	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	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	2'000	0	2'000	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	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593860	0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'805	0	1'805	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	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	1'750	0	1'750	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	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000	0	1'000	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	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	0	1'000	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	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	1'300	0	1'300	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	
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'500	0	1'500	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	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	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.
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	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	1'000	0	1'000	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	
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	1'800	0	1'800	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 % SLHNWX 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	3'000	0	3'000	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	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'600	0	1'600	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	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	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	0	2'000	2'000	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	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	2'000	0	2'000	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	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 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	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	1'000	0	1'000	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	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 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	
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	
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	1'000	0	1'000	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	

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.
CH1101096613	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	2'200	0	2'200	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	1'600	0	1'600	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	1'400	0	1'400	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	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	2'000	0	2'000	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	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	1'500	0	1'500	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	2'000	0	2'000	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	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	3'000	0	3'000	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	
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	2'000	0	2'000	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	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	2'000	0	2'000	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	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	1'000	1'000	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	15'000	5'000	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X51958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52196300698	3.8500 % QNBK 3.85 07/10/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	0	25'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52451378181	2.7500 % KFW 2 3/4 03/03/25 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CNY							0.00	0.00	
CH0336602930	1.2500 % UBS 1 1/4 09/01/26 EMTN	2'050	0	2'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	2'000	0	2'000	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	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	1'500	0	1'500	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.
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534674	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN	500	0	500	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	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002GB5	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 05/25/36 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006TX3	0.7500 % VDP 0 3/4 11/30/41 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTECOE0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	1'000	0	1'000	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	
XS2076079594	0.6250 % SABSM 0 5/8 11/07/25	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2102932055	0.5000 % MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	800	0	800	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	
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2238789460	0.3750 % MDT 0 3/8 10/15/28	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2287624584	0.1250 % MOTOPG 0 1/8 07/20/28 EMTN	200	0	200	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	
XS2320746394	0.9000 % VERA V 0.9 04/01/41	400	0	400	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	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2337252931	0.4500 % FDX 0.45 05/04/29	700	0	700	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	
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	1'100	0	1'100	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	
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	
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 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	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2287624154	1.5000 % MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2348234936	1.6670 % BAC 1.667 06/02/29 EMTN	600	0	600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2385120857	1.1620 % EJRAIL 1.162 09/15/28 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GBP							0.00	0.00	
FR0014003L79	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	0	200'000	200'000	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	
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	400'000	0	400'000	0 JPY	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.
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	500'000	0	500'000	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	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0257403278	2.3000 % DBJP 2.3 03/19/26 INTL	170'000	0	170'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	170'000	0	170'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	300'000	0	300'000	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	
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2352398171	0.3000 % DNBNO 0.3 06/11/27 EMTN	0	300'000	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2387729408	0.4590 % HSBC 0.459 03/24/28 EMTN	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JPY							0.00	0.00	
CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	500	0	0	500 USD	0.00%	0.00	0.00	c)
US00216NAE94	2.3750 % ASBANK 2 3/8 10/22/31 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	1'500	0	1'500	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	
US037833DN70	2.0500 % AAPL 2.05 09/11/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	2'000	0	2'000	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	
US04522KAA43	2.2500 % AIB 2 1/4 05/16/24	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05890PAB22	2.8750 % BCIC 2 7/8 10/14/31 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	2'000	0	2'000	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	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GAP90	3.1000 % CM 3.1 04/02/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967MQ12	3.1060 % C 3.106 04/08/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	500	0	500	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	1'100	0	1'100	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	
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	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	2'400	0	2'400	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	
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DE57	0.8000 % KDB 0.8 04/27/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110BN30	2.0000 % RENTEN 2 01/13/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110CA00	0.8750 % RENTEN 0 7/8 03/30/26	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	900	0	900	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.
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CF95	3.0410 % MSFT 3.041 03/17/62	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	
US6174468G77	4.4310 % MS 4.431 01/23/30 GMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63859VBF76	1.0000 % NWISE 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	
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US717081EY56	1.7000 % PFE 1.7 05/28/30	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US742718FJ38	3.5500 % PG 3.55 03/25/40	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86964WAJ18	3.7500 % SUZANO 3 3/4 01/15/31	100	0	100	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	
US89114QCA40	2.6500 % TD 2.65 06/12/24 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US904764AH00	5.9000 % UNANA 5.9 11/15/32	92	0	92	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PCQ37	4.6250 % UNH 4 5/8 07/15/35	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PDS83	2.8750 % UNH 2 7/8 08/15/29	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEA66	3.1250 % UNH 3 1/8 05/15/60	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PED06	2.3000 % UNH 2.3 05/15/31	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	400	0	400	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	
USH3698DAR55	4.2820 % UBS 4.282 01/09/28 REGS	1'000	0	1'000	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	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP2000TAA36	3.2500 % BANBRA 3 1/4 09/30/26 REGS	500	0	500	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	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2181972568	1.2500 % KDB 1 1/4 06/03/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	1'400	0	1'400	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	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	1'500	0	1'500	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							0.00	0.00	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
CH1328441832	PROCIMMO REAL ESTATE SIC-RTS	0	8'506	8'506	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1329708742	SF RETAIL PROPERTIES - RTS	0	6'726	6'726	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	27'181	27'181	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	11'192	11'192	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							66'237'663.18	8.10	

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.
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INTERSWISS	13'401	0	2'000	11'401 CHF	179.00	2'040'779.00	0.25	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	10'225	0	1'000	9'225 CHF	216.00	1'992'600.00	0.24	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	15'623	0	3'000	12'623 CHF	136.50	1'723'039.50	0.21	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	4'335	0	1'200	3'135 CHF	293.00	918'555.00	0.11	a)
CH0009778769	IMMOFONDS	5'647	0	1'000	4'647 CHF	568.00	2'639'496.00	0.32	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	23'721	0	3'000	20'721 CHF	227.00	4'703'667.00	0.58	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	45'001	0	7'000	38'001 CHF	87.80	3'336'487.80	0.41	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	18'767	0	2'500	16'267 CHF	137.00	2'228'579.00	0.27	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	91'733	0	18'000	73'733 CHF	143.50	10'580'685.50	1.29	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	47'630	0	8'000	39'630 CHF	66.00	2'615'580.00	0.32	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	8'650	0	1'600	7'050 CHF	221.00	1'558'050.00	0.19	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND	6'684	0	1'000	5'684 CHF	194.00	1'102'696.00	0.13	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	40'150	0	17'000	23'150 CHF	19.90	460'685.00	0.06	a)
CH0026725611	BONNOTE - IMMOBILIER	9'087	0	2'000	7'087 CHF	149.00	1'055'963.00	0.13	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	26'284	0	6'000	20'284 CHF	148.00	3'002'032.00	0.37	a)
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	8'506	0	0	8'506 CHF	146.00	1'241'876.00	0.15	a)
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	5'696	0	1'824	3'872 CHF	173.00	669'856.00	0.08	a)
CH0037430946	SWC (CH) REF RESPONSIBLE IFCA FA CHF	12'210	0	2'500	9'710 CHF	170.50	1'655'555.00	0.20	a)
CH0039415010	REALSTONE SWISS PROPERTY	17'197	0	1'500	15'697 CHF	129.00	2'024'913.00	0.25	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	22'992	0	5'000	17'992 CHF	126.00	2'266'992.00	0.28	a)
CH0111959190	SWC (CH) REF RESP SWISS COMMERCIAL FA CHF	7'545	0	0	7'545 CHF	103.50	780'907.50	0.10	a)
CH0120791253	SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND	6'326	0	0	6'326 CHF	122.50	774'935.00	0.09	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	20'307	0	2'000	18'307 CHF	149.00	2'727'743.00	0.33	a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	40'534	0	14'000	26'534 CHF	13.25	351'575.50	0.04	a)
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICPLUS-A	8'358	0	0	8'358 CHF	104.00	869'232.00	0.11	a)
CH0285087455	SF RET PROP FD / UT CHF	6'726	0	0	6'726 CHF	108.00	726'408.00	0.09	a)
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	14'748	0	2'000	12'748 CHF	122.50	1'561'630.00	0.19	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	20'525	0	3'000	17'525 CHF	159.50	2'795'237.50	0.34	a)
CH0414551033	BALOISE SWISS PROPERTY FD	1'816	0	0	1'816 CHF	119.00	216'104.00	0.03	a)
CH							58'621'859.30	7.17	
IE00BYLVK39	UBS ETF BLOOMBERG COMMODITY CMCI H CHF	595'543	0	0	595'543 CHF	12.79	7'615'803.88	0.93	a)
IE							7'615'803.88	0.93	

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

505'860'669.82 61.84

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

505'860'669.82 61.84

CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	0	162'269	0	162'269 CHF	1'393.27	226'083'540.84	27.64	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	315'415	0	0	315'415 CHF	47.25	14'903'027.43	1.82	a)
CH0388442359	SWC (CH) EF RESPONSIBLE SMC CH (II) NT CHF	164'334	4'819	0	169'153 CHF	124.14	20'998'248.45	2.57	a)
CH0394628066	SWC (CH) MMF RESPONSIBLE OPPTS CHF NT CHF	31'351	0	0	31'351 CHF	96.53	3'026'359.06	0.37	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	121'222	0	0	121'222 CHF	147.44	17'872'496.02	2.18	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS.GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	0	1'901'406	0	1'901'406 CHF	86.48	164'424'644.76	20.10	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	54'469	0	0	54'469 CHF	93.41	5'087'841.44	0.62	a)
CH							452'396'158.00	55.31	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	17'080	0	0	17'080 USD	293.98	4'522'627.69	0.55	a)
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	130'294	0	0	130'294 USD	131.12	15'387'693.26	1.88	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	73'767	0	3'373	70'394 CHF	129.48	9'114'574.76	1.11	a)
LU2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPTS NT	112'521	142'522	0	255'043 USD	106.39	24'439'616.11	2.99	a)
LU							53'464'511.82	6.54	

Derivative Finanzinstrumente

688'519.19 0.08

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.
Futures							0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	8	0	8	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	-331	331	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	184	184	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	-127	127	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	MSCI EMGMKT DEC23	-56	56	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	44	16	60	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	-25	25	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	AUST 10Y BOND FUT DEC23	116	0	116	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US LONG BOND(CBT) DEC23	25	0	25	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	BCOM COMDTY IND DEC23	0	833	833	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	-19	19	0	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	CAN 10YR BOND FUT DEC23	-102	102	0	0 CAD	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	75	75	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	50	50	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	12	12	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	698	698	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	191	191	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	106	106	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	MSCI EMGMKT MAR24	0	159	159	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NASDAQ 100 E-MINI MAR24	0	52	52	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	25	25	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	116	116	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US LONG BOND(CBT) MAR24	0	25	25	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	BCOM COMDTY IND MAR24	0	833	833	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	19	19	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	102	102	0 CAD	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	50	0	50 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	12	0	12 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NIKKEI 225 (SGX) JUN24	0	68	75	-7 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	BCOM COMDTY IND JUN24	0	833	0	833 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US LONG BOND(CBT) JUN24	0	25	0	25 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	0	183	-183 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	0	7	-7 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	0	54	-54 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	0	18	-18 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	MSCI EMGMKT JUN24	0	103	0	103 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NASDAQ 100 E-MINI JUN24	0	52	28	24 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	0	102	-102 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		65'738'889	72'405'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		88'218'000	7'568'487		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		7'558'000	4'462'417		AUD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		16'259'028	14'609'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		5'368'658	7'937'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		43'978'103	45'570'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		19'406'423	3'169'446'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		16'017'599	128'514'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		11'093'524	1'846'597'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		4'075'000	2'652'784		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		56'954'579	63'346'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		49'268'936	51'426'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		15'612'868	14'262'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		7'765'000	4'453'453		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		15'900'993	129'430'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		49'068'529	51'426'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		55'223'459	63'346'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		15'758'840	14'262'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		7'765'000	4'486'904		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		4'075'000	2'612'535		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		15'840'420	129'430'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		18'449'306	3'099'635'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		91'138'000	7'513'508		NOK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		62'082'323	74'062'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		19'081'935	3'205'254'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		16'029'949	15'006'000		CHF/GBP	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.	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		41'155'383	44'316'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		15'491'939	131'202'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		5'665'000	3'588'517		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		7'551'000	4'325'130		AUD/CHF	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 01.03.2024		4'787'821	7'461'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 01.03.2024		51'019'970	54'734'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 01.03.2024		74'940'870	87'045'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 01.03.2024		15'653'601	130'388'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CHF/NOK Verfall 01.03.2024		92'742'000	7'620'425		NOK/CHF	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 01.03.2024		19'387'762	3'310'469'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 01.03.2024		16'485'345	15'099'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 01.03.2024		7'580'000	4'295'942		AUD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		76'398'004	87'045'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		19'373'626	3'310'469'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		52'054'169	54'734'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		16'769'840	15'099'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		15'893'124	130'388'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CHF/NOK Verfall 03.04.2024		92'742'000	7'693'413		NOK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		7'580'000	4'331'523		AUD/CHF	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		4'829'729	7'461'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	USD/JPY Verfall 03.04.2024		2'050'700'000	13'921'455		JPY/USD	0.00	0.00		
	JPY/USD Verfall 03.04.2024		13'818'249	2'050'700'000		USD/JPY	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		88'185'000	79'390'839		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		2'949'005'000	17'559'762		JPY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		2'469'000	2'812'174		GBP/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		37'591'000	36'747'007		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		114'122'000	14'183'539		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		5'543'000	3'678'695		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NOK Verfall 02.05.2024		93'146'000	7'758'689		NOK/CHF	-47'364.58	-0.01	b)	
	CAD/CHF Verfall 02.05.2024		1'133'267	1'707'000		CHF/CAD	771.30	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		17'957'758	18'426'000		CHF/EUR	76'101.76	0.01	b)	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2024		14'146'813	12'439'000		CHF/GBP	44'415.86	0.01	b)	
	CHF/USD Verfall 02.05.2024		1'760'000	1'589'720		USD/CHF	-10'384.58	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 02.05.2024		2'017'043	336'734'000		CHF/JPY	10'040.68	0.00	b)	
	CHF/AUD Verfall 02.05.2024		12'968'000	7'607'509		AUD/CHF	-8'521.65	0.00	b)	
	CNY/CHF Verfall 06.05.2024		2'039'902	16'392'000		CHF/CNY	11'863.99	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte								76'922.78	0.01	

Swaps

								Kurswert CHF	in % 7)	
04/33	IRS FIX LEG 1.8125% P.A. CHF	10'000	0	0	10'000	CHF	106.12%	10'611'596.41	1.30	b)
04/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-10'000	0	0	-10'000	CHF	100.00	-10'000'000.00	-1.22	b)
								611'596.41	0.07	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	17'974'387.19	2.20
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	222'188'955.99	27.16
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	572'098'333.00	69.94
Andere Anlagen - Metallkonten	3'837'350.75	0.47
Derivative Finanzinstrumente	688'519.19	0.08
Sonstige Vermögenswerte	1'185'815.97	0.14
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	817'973'362.09	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-779'344.93	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	817'194'017.16	

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);	794'287'288.99	97.10
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	688'519.19	0.08
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

14'696'305.82 1.80

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.03.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte				5'343'753.32	0.65
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	179 EUR	833.70	145'165.98	0.02
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	7'375 USD	152.26	1'011'411.79	0.12
US1491231015	CATERPILLAR INC	2'588 USD	366.43	854'152.58	0.10
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	403 USD	732.63	265'931.58	0.03
US4612021034	INTUIT INC	1'104 USD	650.00	646'342.32	0.08
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	2'309 USD	481.57	1'001'528.98	0.12
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	5'646 USD	279.08	1'419'220.09	0.17
Andere Wertpapiere				9'352'552.50	1.14
CH0002785456	SOLVALOR 61	3'135 CHF	293.00	918'555.00	0.11
CH0009778769	IMMOFONDS	350 CHF	568.00	198'800.00	0.02
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	32'600 CHF	143.50	4'678'100.00	0.57
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	23'150 CHF	19.90	460'685.00	0.06
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	7'087 CHF	149.00	1'055'963.00	0.13
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	3'272 CHF	173.00	566'056.00	0.07
CH0111959190	SWC (CH) REF RESP SWISS COMMERCIAL FA CHF	1'547 CHF	103.50	160'114.50	0.02
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	7'371 CHF	149.00	1'098'279.00	0.13
CH0285087455	SF RET PROP FD / UT CHF	2'000 CHF	108.00	216'000.00	0.03

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
DKK	100 = CHF	13.04133800
EUR	1 = CHF	0.97275172
GBP	1 = CHF	1.13780928
HKD	100 = CHF	11.50841100
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

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	8'425'790.20	20.652
Bond	CHF	32'372'727.86	79.348
Total	CHF	40'798'518.06	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	128'587'036.85	15.735
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	86'141'416.01	10.541
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	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	5'343'753.32
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	9'352'552.50

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	1.200	1.600	0.950	0.250	4.000
CT CHF	0.650	1.050	0.400	0.250	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

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.