

Helvetia Allegra Fonds

Halbjahresbericht

28. Juni 2024



INHALTSVERZEICHNIS

Fondsinformationen	3
Akteure in der Laufzeit des Fonds	4
Allgemeine Angaben zum Umbrella-Fonds bzw. zu den Teilvermögen.....	5
Bericht des Vermögenswalters	7
Performances	9
Vergütungen.....	10
Grundsätze für die Bewertung und Berechnung des Nettoinventarwerts.....	13
HELVETIA ALLEGRA ONE	16
HELVETIA ALLEGRA 30.....	28
HELVETIA ALLEGRA 50.....	48
HELVETIA ALLEGRA 85.....	68

Helvetia Allegra Fonds ist ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" gemäss Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG), welcher in die folgenden Teilvermögen unterteilt ist:

- Helvetia Allegra ONE
- Helvetia Allegra 30
- Helvetia Allegra 50
- Helvetia Allegra 85

Fondsleitung

CACEIS (Switzerland) SA

Route de Signy 35,
1260 Nyon

Depotbank

CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung

Nyon / Schweiz
Route de Signy 35,
1260 Nyon

CACEIS (Switzerland) SA**Verwaltungsrat:**

Thies Clemenz	Präsident (bis 12.12.2023)
Joseph Saliba	Präsident (ab 13.05.2024)
Yvar Mentha	Vizepräsident
Jacques Bourachot	Mitglied
Marc-André Poirier	Mitglied
Jean-Pierre Valentini	Mitglied
Fernando Valenzuela	Mitglied (ab 13.05.2024)

Geschäftsleitung:

Oscar Garcia	Geschäftsführer
Claude Marchal	Vizedirektor
Lionel Bauer	Vizedirektor

Beauftragter Vermögensverwalter:

Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG,
Dufourstrasse 40,
9001 St. Gallen

Depotbank:

CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz
Route de Signy 35,
1260 Nyon

Prüfgesellschaft:

KPMG AG
Esplanade de Pont-Rouge 6,
1211 Genf

Helvetia Allegra Fonds ist ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" gemäss Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG), welcher in die folgenden Teilvermögen unterteilt ist:

- Helvetia Allegra ONE
- Helvetia Allegra 30
- Helvetia Allegra 50
- Helvetia Allegra 85

Der Fondsvertrag wurde von der CACEIS (Switzerland) SA als Fondsleitung aufgestellt und mit Zustimmung der CACEIS Bank, Paris, succursale de Nyon / Suisse, als Depotbank aufgestellt und wurde erstmals am 09. Mai 2018 von der Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA (die "FINMA") genehmigt.

Die Teilvermögen basieren auf einem Kollektivanlagevertrag (Fondsvertrag), in dem sich die Fondsleitung verpflichtet, den Anleger¹ nach Massgabe der von ihm erworbenen Fondsanteile am entsprechenden Teilvermögen zu beteiligen und dieses gemäss den Bestimmungen von Gesetz und Fondsvertrag selbständig und im eigenen Namen zu verwalten. Die Depotbank nimmt nach Massgabe der ihr durch Gesetz und Fondsvertrag übertragenen Aufgaben am Fondsvertrag teil.

Zurzeit können für die Teilvermögen Anteilklassen mit den Bezeichnungen A1, A2, E, H1, H2, R1, R2 und I1 eröffnet werden:

Klasse A1	Anteile der A1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen der Helvetia Schweizerische Lebensversicherungsgesellschaft AG in Verbindung mit neuen Lebensversicherungsverträgen offen.
Klasse A2	Anteile der A2 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen der Helvetia Schweizerische Lebensversicherungsgesellschaft AG ausschliesslich in Verbindung mit bestehenden Lebensversicherungsverträgen offen.
Klasse E	E Anteile der E Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an professionelle Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3 und 3ter KAG in Verbindung mit Helvetia Vorsorgelösungen wenden.
Klasse H1	Anteile der H1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen ausschliesslich den Gruppengesellschaften der Helvetia Holding AG offen.
Klasse H2	Anteile der H2 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen ausschliesslich den Vorsorgeeinrichtungen der Helvetia Gruppe offen.
Klasse R1	Anteile der R1 Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an das gesamte Anlegerpublikum wenden.
Klasse R2	Anteile der R2 Klasse sind thesaurierende Anteile, die sich an das gesamte Anlegerpublikum ausschliesslich mit bestehenden Verträgen mit der Helvetia Gruppe, wenden.
Klasse I1	Anteile der I1 Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen qualifizierten Anlegern gemäss Art. 10 Abs. 3 KAG offen. Die Mindestanlage für diese Klasse ist CHF 10 Millionen.

Die Referenzwährung der Klassen A1, A2, E, H1, H2, R1, R2 und I1 entspricht der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens.

Der Anleger ist nur am Vermögen und am Ertrag desjenigen Teilvermögens berechtigt, an dem er beteiligt ist. Für die auf einem einzelnen Teilvermögen entfallenden Verbindlichkeiten haftet nur das entsprechende Teilvermögen.

¹ Aus Gründen der einfacheren Lesbarkeit wird auf die geschlechtsspezifische Differenzierung, z.B. Anlegerinnen und Anleger, verzichtet. Entsprechende Begriffe gelten grundsätzlich für beide Geschlechter.

Gemäss Fondsvertrag steht der Fondsleitung das Recht zu, mit Zustimmung der Depotbank und Genehmigung der Aufsichtsbehörde für jedes Teilvermögen jederzeit verschiedene Anteilsklassen zu schaffen, aufzuheben oder zu vereinigen.

Bericht des Vermögensverwalters

Helvetia Allegra ONE Fonds

Das Marktgeschehen im Rückblick in Q2 2024

Die Weltwirtschaft wuchs auch im zweiten Quartal moderat, wobei die USA ihren klaren Wachstumsvorsprung gegenüber Europa aufrechterhalten konnte. Während in der Schweiz die Preisstabilität (jährliche Inflationsraten unter 2%) wieder hergestellt wurde, bleibt die Teuerung in der Eurozone und in den USA erhöht. Aufgrund des robusten Wirtschaftswachstums erwies sich besonders die US-Inflation als hartnäckig. Immerhin konnte die Kerninflation, welche die volatilen Komponenten wie Rohstoff- und Energiepreise ausschliesst, ihren Abwärtstrend fortsetzen. Die unterschiedliche Lage an der Inflationsfront spiegelte sich in der Geldpolitik der jeweiligen Wirtschaftsräume. So konnte die SNB die Zinsen im Juni bereits zum zweiten Mal um 25 Basispunkte senken (neu 1.25%) und auch die EZB hat auf die rückläufigen Inflationszahlen mit einer Zinssenkung (neu 4.25%) reagiert. Die US Fed ihrerseits hat den Leitzins aufgrund des anhaltend starken Inflationsdrucks unverändert auf 5.25% belassen.

Die globalen Anleihen gaben etwas nach (Bloomberg Global Aggregate -1.1%), wobei die Schweizer Anleihen mit einer positiven Rendite eine Ausnahme bildeten. Sie profitierten von der tiefen Inflation, den SNB-Zinssenkungen und ihrem Status als sicherer europäischer Hafen.

Portfolioaktivität in Q2 2024

Es wurden keine Änderungen im Portfolio vorgenommen.

Helvetia Allegra 30 Fonds

Das Marktgeschehen im Rückblick in Q2 2024

Die Weltwirtschaft wuchs auch im zweiten Quartal moderat, wobei die USA ihren klaren Wachstumsvorsprung gegenüber Europa aufrechterhalten konnte. Während in der Schweiz die Preisstabilität (jährliche Inflationsraten unter 2%) wieder hergestellt wurde, bleibt die Teuerung in der Eurozone und in den USA erhöht. Aufgrund des robusten Wirtschaftswachstums erwies sich besonders die US-Inflation als hartnäckig. Immerhin konnte die Kerninflation, welche die volatilen Komponenten wie Rohstoff- und Energiepreise ausschliesst, ihren Abwärtstrend fortsetzen. Die unterschiedliche Lage an der Inflationsfront spiegelte sich in der Geldpolitik der jeweiligen Wirtschaftsräume. So konnte die SNB die Zinsen im Juni bereits zum zweiten Mal um 25 Basispunkte senken (neu 1.25%) und auch die EZB hat auf die rückläufigen Inflationszahlen mit einer Zinssenkung (neu 4.25%) reagiert. Die US Fed ihrerseits hat den Leitzins aufgrund des anhaltend starken Inflationsdrucks unverändert auf 5.25% belassen.

Die globalen Aktienmärkte erzielten eine positive Quartalsrendite. Der S&P 500 konnte um 4.3% zulegen und der Schweizer SMI um 4.0%. Die Aktien der Eurozone (-1.6%) litten jedoch unter den politischen Unsicherheiten, die nach der Ankündigung der französischen Parlamentswahlen aufkeimten. Die globalen Anleihen gaben etwas nach (Bloomberg Global Aggregate -1.1%), wobei die Schweizer Anleihen mit einer positiven Rendite eine Ausnahme bildeten. Sie profitierten von der tiefen Inflation, den SNB-Zinssenkungen und ihrem Status als sicherer europäischer Hafen.

Portfolioaktivität in Q2 2024

Gewinne haben wir regelmäßig aus Aktien realisiert und die Erlöse in Obligationen reinvestiert.

Helvetia Allegra 50 Fonds

Das Marktgeschehen im Rückblick in Q2 2024

Die Weltwirtschaft wuchs auch im zweiten Quartal moderat, wobei die USA ihren klaren Wachstumsvorsprung gegenüber Europa aufrechterhalten konnte. Während in der Schweiz die Preisstabilität (jährliche Inflationsraten unter 2%) wieder hergestellt wurde, bleibt die Teuerung in der Eurozone und in den USA erhöht. Aufgrund des robusten Wirtschaftswachstums erwies sich besonders die US-Inflation als hartnäckig. Immerhin konnte die Kerninflation, welche die volatilen Komponenten wie Rohstoff- und Energiepreise ausschliesst, ihren Abwärtstrend fortsetzen. Die unterschiedliche Lage an der Inflationsfront spiegelte sich in der Geldpolitik der jeweiligen Wirtschaftsräume. So konnte die SNB die Zinsen im Juni bereits zum zweiten Mal um 25 Basispunkte senken (neu 1.25%) und auch die EZB hat auf die rückläufigen Inflationszahlen mit einer Zinssenkung (neu 4.25%) reagiert. Die US Fed ihrerseits hat den Leitzins aufgrund des anhaltend starken Inflationsdrucks unverändert auf 5.25% belassen.

Die globalen Aktienmärkte erzielten eine positive Quartalsrendite. Der S&P 500 konnte um 4.3% zulegen und der Schweizer SMI um 4.0%. Die Aktien der Eurozone (-1.6%) litten jedoch unter den politischen Unsicherheiten, die nach der Ankündigung der französischen Parlamentswahlen aufkeimten. Die globalen Anleihen gaben etwas nach (Bloomberg Global Aggregate -1.1%), wobei die Schweizer Anleihen mit einer positiven Rendite eine Ausnahme bildeten. Sie profitierten von der tiefen Inflation, den SNB-Zinssenkungen und ihrem Status als sicherer europäischer Hafen.

Portfolioaktivität in Q2 2024

Gewinne haben wir regelmäßig aus Aktien realisiert und die Erlöse in Obligationen reinvestiert.

Helvetia Allegra 85 Fonds

Das Marktgeschehen im Rückblick in Q2 2024

Die Weltwirtschaft wuchs auch im zweiten Quartal moderat, wobei die USA ihren klaren Wachstumsvorsprung gegenüber Europa aufrechterhalten konnte. Während in der Schweiz die Preisstabilität (jährliche Inflationsraten unter 2%) wieder hergestellt wurde, bleibt die Teuerung in der Eurozone und in den USA erhöht. Aufgrund des robusten Wirtschaftswachstums erwies sich besonders die US-Inflation als hartnäckig. Immerhin konnte die Kerninflation, welche die volatilen Komponenten wie Rohstoff- und Energiepreise ausschliesst, ihren Abwärtstrend fortsetzen. Die unterschiedliche Lage an der Inflationsfront spiegelte sich in der Geldpolitik der jeweiligen Wirtschaftsräume. So konnte die SNB die Zinsen im Juni bereits zum zweiten Mal um 25 Basispunkte senken (neu 1.25%) und auch die EZB hat auf die rückläufigen Inflationszahlen mit einer Zinssenkung (neu 4.25%) reagiert. Die US Fed ihrerseits hat den Leitzins aufgrund des anhaltend starken Inflationsdrucks unverändert auf 5.25% belassen.

Die globalen Aktienmärkte erzielten eine positive Quartalsrendite. Der S&P 500 konnte um 4.3% zulegen und der Schweizer SMI um 4.0%. Die Aktien der Eurozone (-1.6%) litten jedoch unter den politischen Unsicherheiten, die nach der Ankündigung der französischen Parlamentswahlen aufkeimten. Die globalen Anleihen gaben etwas nach (Bloomberg Global Aggregate -1.1%), wobei die Schweizer Anleihen mit einer positiven Rendite eine Ausnahme bildeten. Sie profitierten von der tiefen Inflation, den SNB-Zinssenkungen und ihrem Status als sicherer europäischer Hafen.

Portfolioaktivität in Q2 2024

Gewinne haben wir regelmäßig aus Aktien realisiert und die Erlöse in Obligationen reinvestiert.

Performances

	Lancierung	2023	2024 ¹	Seit Lancierung¹
Helvetia Allegra ONE Klasse A1	01.07.2019	3.77%	0.91%	-5.81%
Helvetia Allegra ONE Klasse A2	01.07.2019	3.45%	0.76%	-7.21%
Helvetia Allegra ONE Klasse H1	01.07.2019	3.92%	0.98%	-5.07%
Helvetia Allegra ONE Klasse R1	01.07.2019	3.77%	0.91%	-5.81%
Helvetia Allegra ONE Klasse E	18.01.2022	3.98%	1.03%	-4.49%
Helvetia Allegra 30 Klasse A1	08.08.2018	5.22%	4.43%	7.55%
Helvetia Allegra 30 Klasse A2	08.08.2018	4.91%	4.27%	5.70%
Helvetia Allegra 30 Klasse H1	02.07.2018	5.69%	4.66%	11.97%
Helvetia Allegra 30 Klasse R1	08.08.2018	5.22%	4.43%	7.55%
Helvetia Allegra 30 Klasse E	18.01.2022	5.54%	4.58%	-2.79%
Helvetia Allegra 50 Klasse A1	08.08.2018	5.16%	6.02%	12.52%
Helvetia Allegra 50 Klasse A2	08.08.2018	4.84%	5.87%	10.54%
Helvetia Allegra 50 Klasse H1	02.07.2018	5.65%	6.28%	18.20%
Helvetia Allegra 50 Klasse R1	08.08.2018	5.15%	6.03%	12.59%
Helvetia Allegra 50 Klasse E	18.01.2022	5.52%	6.21%	-1.94%
Helvetia Allegra 85 Klasse A1	01.07.2019	6.75%	10.77%	26.61%
Helvetia Allegra 85 Klasse A2	01.07.2019	6.43%	10.61%	24.67%
Helvetia Allegra 85 Klasse R1	01.07.2019	6.75%	10.77%	26.61%
Helvetia Allegra 85 Klasse E	18.01.2022	7.17%	10.99%	3.05%

¹ : bis 28.06.2024

Vergangene Angaben zur Performance sind kein Hinweis auf noch keine Garantie für die aktuelle oder zukünftige Performance und berücksichtigen weder Ausgabe- noch Rücknahmegebühren oder entsprechende - Kommissionen.

Gemäss Fondsvertrag findet für diesen Anlagefonds kein Benchmark Anwendung.

Vergütungen

Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten der Anleger (Auszug aus § 18 des Fondsvertrags)

Ausgabekommission zugunsten der Fondsleitung und /oder der Depotbank	höchstens 1.50%
Rücknahmekommission zugunsten der Fondsleitung und /oder der Depotbank	höchstens 1.50%

Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Fondsvermögens (Auszug aus § 19 des Fondsvertrags)

Verwaltungskommission der Fondsleitung	maximal 1.60% p.a.
--	---------------------------

Die Kommission wird verwendet für die Leitung, das Asset Management wie auch für die Entschädigung der Depotbank für die von ihr erbrachten Dienstleistungen wie die Aufbewahrung des Vermögens der Teilvermögen bzw. des Umbrella-Fonds, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen in § 4 aufgeführten Aufgaben des Umbrella-Fonds.

Zusätzlich können den Teilvermögens bzw. des Umbrella-Fonds die weiteren in § 19 des Fondsvertrags aufgeführten Vergütungen und Nebenkosten in Rechnung gestellt werden.

Die effektiv angewandten Sätze sind jeweils aus dem Jahres- und Halbjahresbericht ersichtlich.

Effektiv zur Anwendung kommende Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen

Helvetia Allegra ONE

<u>Für Klasse A1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.30%
<u>Für Klasse A2</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.60%
<u>Für Klasse H1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.15%
<u>Für Klasse R1</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.30%
<u>Für Klasse E</u> Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds	0.25%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Fondsleitung	0.03%
<u>Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E</u> Kommission für die Depotbank	0.03%

Helvetia Allegra 30Für Klasse A1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.60%Für Klasse A2

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.90%Für Klasse H1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.15%Für Klasse R1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.60%Für Klasse E

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.30%Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E

Kommission für die Fondsleitung

0.03%Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E

Kommission für die Depotbank

0.03%**Helvetia Allegra 50**Für Klasse A1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.70%Für Klasse A2

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

1.00%Für Klasse H1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.25%Für Klasse R1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.70%Für Klasse E

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.35%Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E

Kommission für die Fondsleitung

0.03%Für die Klassen A1, A2, H1, R1 und E

Kommission für die Depotbank

0.03%

Helvetia Allegra 85Für Klasse A1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.80%Für Klasse A2

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

1.10%Für Klasse R1

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.80%Für Klasse E

Kommission für das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds

0.40%Für die Klassen A1, A2, R1 und E

Kommission für die Fondsleitung

0.03%Für die Klassen A1, A2, R1 und E

Kommission für die Depotbank

0.03%**«Soft Commissions»**

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «Soft Commissions» geschlossen.

Grundsätze für die Bewertung und Berechnung des Nettoinventarwerts

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens der entsprechenden Teilvermögen statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt:
Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Klasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffender Klasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.01 gerundet.

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, von mindestens oder mehr als 2% des Nettofondsvermögens des Teilvermögens, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des jeweiligen Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).

7. Die Anpassung beläuft sich auf 0.40% des Bewertungs-Nettoinventarwertes des HelvetiaAllegra ONE Teilvermögen, auf 0.30% des Helvetia Allegra 30 Teilvermögen, auf 0.25% des Helvetia Allegra 50 Teilvermögen und jeweils auf 0.25% des Helvetia Allegra 85 Teilvermögen. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und die Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, 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 Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Teilvermögens bewirken. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein-oder Auszahlung in bar gemäss § 17 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Anlagefonds. Der unter Anwendung des Swinging Helvetia Allegra Fonds Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögens 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) wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur 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 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.

Nettoinventarwert pro Anteil am 28.06.24 :

Helvetia Allegra ONE

Klasse A1: CHF 93.22

Klasse A2: CHF 92.27

Klasse H1: CHF 93.71

Klasse R1: CHF 93.22

Klasse E: CHF 94.84

Helvetia Allegra 30

Klasse A1: CHF 106.21

Klasse A2: CHF 104.96

Klasse H1: CHF 109.60

Klasse R1: CHF 106.22

Klasse E: CHF 96.53

Helvetia Allegra 50

Klasse A1: CHF 110.78

Klasse A2: CHF 108.83

Klasse H1: CHF 116.38

Klasse R1: CHF 110.86

Klasse E: CHF 97.49

Helvetia Allegra 85

Klasse A1: CHF 125.18

Klasse A2: CHF 123.49

Klasse R1: CHF 125.18

Klasse E: CHF 102.37

Vermögensrechnung

	28.06.24	31.12.23
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	33'485'700.84	33'631'999.95
Investmentfondsanteile	13'643'578.02	13'736'925.26
Bankguthaben		
Sichtguthaben	616'229.57	470'506.01
Sonstige Vermögenswerte	306'130.45	219'726.38
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	48'051'638.88	48'059'157.60
Andere Verbindlichkeiten	-296'214.43	-52'047.98
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	47'755'424.45	48'007'109.62

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	48'007'109.62	46'727'211.23
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-171'052.09	-89'826.18
Saldo aus dem Anteilverkehr	-519'925.56	-372'492.47
Gesamterfolg	439'292.48	1'742'217.04
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	47'755'424.45	48'007'109.62

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse A1

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		38'228.333	38'228.333
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		38'228.333	38'228.333
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	93.22	92.70

Klasse A2

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		117'983.894	117'983.894
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		117'983.894	117'983.894
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	92.27	91.80

Klasse H1

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		312'255.334	312'255.334
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		312'255.334	312'255.334
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	93.71	93.17

Klasse R1

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		48'954.000	53'247.000
Ausgegebene Anteile		4'615.000	7'059.000
Zurückgenommene Anteile		10'217.000	11'352.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		43'352.000	48'954.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	93.22	92.70

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse E**

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	10.000	10.000
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	10.000	10.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 94.84	94.28

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Erträge der Obligationen	205'993.46	326'432.03
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	168'242.80	326'088.02
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	3'972.87	10'060.97
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	933.25	4'134.07
Total Erträge	379'142.38	666'715.09
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen :		
an die Fondsleitung	-7'086.63	-14'047.44
an die Depotbank	-7'221.63	-14'197.44
an die Verwaltung	-65'363.49	-129'646.41
Prüfaufwand	-5'892.20	-11'847.00
Sonstige Aufwendungen	-1'181.17	-2'777.05
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-4'421.88	-3'514.81
Total Aufwendungen	-91'167.00	-176'030.15
Nettoertrag	287'975.38	490'684.94
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-338'275.36	-670'051.81
Realisierter Erfolg	-50'299.98	-179'366.87
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	489'592.46	1'921'583.91
Gesamterfolg	439'292.48	1'742'217.04
<u>Synthetische TER in %</u> : Klasse A1	0.44	0.46
<u>Synthetische TER in %</u> : Klasse A2	0.74	0.76
<u>Synthetische TER in %</u> : Klasse H1	0.29	0.31
<u>Synthetische TER in %</u> : Klasse R1	0.44	0.46
<u>Synthetische TER in %</u> : Klasse E	0.18	0.20

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8.

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								
Anleihen								
COMMONW BK AUSTRALIA 0.40 17-26 25/09A	25.09.26	250'000	0	0	250'000	98.29	245'712.50	0.51
NATIONAL AUSTRALIA 0.2925 22-28 03/02A	03.02.28	250'000	0	0	250'000	96.91	242'266.25	0.50
NATIONAL AUSTRALIA 0.5650 22-31 03/02A	03.02.31	250'000	0	0	250'000	95.50	238'742.50	0.50
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.065 20-29 29/01A	29.01.29	250'000	0	0	250'000	94.82	237'056.25	0.49
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.125 19-27 21/06A	21.06.27	250'000	0	0	250'000	96.82	242'052.50	0.50
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30 17-25 31/10A	31.10.25	250'000	0	0	250'000	98.72	246'801.25	0.51
WESTPAC BANKING 0.50 18-28 16/05A	16.05.28	250'000	0	0	250'000	97.09	242'717.50	0.51
WESTPAC BANKING GROUP 0.30 17- 25 28/11A	28.11.25	250'000	0	0	250'000	98.50	246'261.25	0.51
<i>Australien</i>							<i>1'941'610.00</i>	<i>4.04</i>
SCOTIABANK CHILE 0.385 21-26 22/07A	22.07.26	200'000	0	0	200'000	97.14	194'282.00	0.40
<i>Chile</i>							<i>194'282.00</i>	<i>0.40</i>
BERLIN HYP AG 2.2500 23-27 08/11A	08.11.27	200'000	0	0	200'000	102.61	205'217.00	0.43
DEUTSCHE BAHN F 0.1000 21-36 28/01A	28.01.36	250'000	0	0	250'000	86.86	217'151.25	0.45
DEUTSCHE BAHN FIN 0.50 18-28 18/07A	18.07.28	300'000	0	0	300'000	97.69	293'067.00	0.61
EON SE 1.86 22-25 05/12A	05.12.25	250'000	0	0	250'000	100.95	252'385.00	0.53
EON SE 2.5025 22-29 05/12A	05.12.29	250'000	0	0	250'000	106.26	265'656.25	0.55
LANDESBANK BADEN-WUR 2.602 23- 28 04/10A	04.10.28	100'000	0	0	100'000	102.96	102'960.50	0.21
MUENCHENER HYPO 0.25 20-28 18/09A	18.09.28	100'000	0	0	100'000	95.16	95'163.00	0.20
MUENCHENER HYPOTHEKE 0.25 21- 27 30/03A	30.03.27	200'000	0	0	200'000	96.40	192'807.00	0.40
<i>Deutschland</i>							<i>1'624'407.00</i>	<i>3.38</i>
NORDEA BANK AB 0.55 15-25 23/06A	23.06.25	250'000	0	0	250'000	99.30	248'245.00	0.52
<i>Finnland</i>							<i>248'245.00</i>	<i>0.52</i>
BFCM 0.25 21-29 21/06A	21.06.29	250'000	0	0	250'000	93.98	234'961.25	0.49
BFCM 0.40 17-25 19/12A	19.12.25	250'000	0	0	250'000	98.73	246'813.75	0.51
BFCM 1.00 18-26 13/11A	13.11.26	150'000	0	0	150'000	99.17	148'750.50	0.31
BNP PAR 2.63 23-29 07/06A	07.06.29	200'000	0	0	200'000	105.20	210'406.00	0.44
BNP PARIBAS SA 2.8925 22-29 27/09A27/09A	27.09.29	200'000	0	0	200'000	105.17	210'346.00	0.44
BPCE SA 2.655 23-30 12/06A	12.06.30	250'000	0	0	250'000	105.72	264'306.25	0.55
CREDIT AGRICOLE SA 3.042 22-27 29/09A09A	29.09.27	400'000	0	0	400'000	104.32	417'298.00	0.87
ENGIE 2.34 23-27 04/01A	04.01.27	300'000	0	0	300'000	102.01	306'042.00	0.64
ENGIE SPA 2.49 23-31 04/07A	04.07.31	100'000	0	0	100'000	104.73	104'734.00	0.22
TOTAL CAPITAL INTL 1.00 14-24 29/08A	29.08.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Frankreich</i>							<i>2'143'657.75</i>	<i>4.46</i>

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
LLOYDS BANKING GROUP 1.00 18-25 04/09A	04.03.25	250'000	0	0	250'000	99.80	249'496.25	0.52
UBS AG LONDON 2.55 23-29 09/05A	09.05.29	250'000	0	0	250'000	105.22	263'046.25	0.55
<i>Großbritannien</i>							512'542.50	1.07
BANK OF MONTREAL 2.26 23-29 01/02A	01.02.29	100'000	0	0	100'000	103.90	103'896.00	0.22
BANK OF NOVA SCOTIA 2.382 23-27 22/09A	22.09.27	100'000	0	0	100'000	103.10	103'102.50	0.21
CIBC 0.05 19-26 15/10A5 19-26 15/10A	15.10.26	300'000	0	0	300'000	97.06	291'165.00	0.61
CIBC 0.18 21-29 20/04A	20.04.29	150'000	0	0	150'000	94.16	141'234.75	0.29
<i>Kanada</i>							639'398.25	1.33
LGT BANK AG 0.20 16-26 12/10A	12.10.26	250'000	0	0	250'000	97.53	243'812.50	0.51
LGT BANK AG 0.50 17-27 12/05A	12.05.27	250'000	0	0	250'000	97.71	244'270.00	0.51
LGT BANK AG 0.625 15-25 25/11A	25.11.25	250'000	0	0	250'000	99.05	247'635.00	0.52
LGT BANK IN LIECHTENST 0.45 21-31 29/07A	29.07.31	200'000	0	0	200'000	91.48	182'955.00	0.38
LIECHTENSTEIN LDBANK 0.125 19-26 28/05A	28.05.26	150'000	0	0	150'000	97.77	146'653.50	0.31
<i>Liechtenstein</i>							1'065'326.00	2.22
TRATON FINANCE LUXEM 2.15 24-27 18/06A	18.06.27	0	250'000	0	250'000	101.16	252'908.75	0.53
<i>Luxemburg</i>							252'908.75	0.53
ABN AMRO BANK 2.505 23-28 26/06A	26.06.28	200'000	0	0	200'000	103.80	207'594.00	0.43
ABN AMRO BK 2.3 23-25 26/06A	26.06.25	200'000	0	0	200'000	100.89	201'783.00	0.42
COOPERATIEVE RABOBK 3.125 06/26 15/09A	15.09.26	500'000	0	0	500'000	104.11	520'525.00	1.08
SHELL INT FIN 0.875 15-28 21/08A	21.08.28	250'000	0	0	250'000	99.06	247'661.25	0.52
TOYOTA MOTOR FINANCE 2.13 23-27 15/06A	15.06.27	200'000	0	0	200'000	102.25	204'497.00	0.43
VOLKSWAGEN FINANCIAL 2.2075 24-27 12/02A	12.02.27	0	200'000	0	200'000	101.53	203'061.00	0.42
<i>Niederlande</i>							1'585'121.25	3.30
SPAREBANK 1 SMN 1.5 22-27 15/06A 15/06A	15.06.27	300'000	0	0	300'000	100.40	301'192.50	0.63
<i>Norwegen</i>							301'192.50	0.63
BAWAG BK 2.955 22-27 29/11A	29.11.27	250'000	0	0	250'000	104.30	260'738.75	0.54
RLB OBEROESTERREICH 2.63 23-28 29/06A	29.06.28	150'000	0	0	150'000	103.49	155'238.00	0.32
<i>Österreich</i>							415'976.75	0.87
AAREKRAFTWERK K 0.6250 19-29 03/08A	03.08.29	250'000	0	0	250'000	96.39	240'965.00	0.50
<i>Schweden</i>							240'965.00	0.50
AEW ENERGIE AG 1.5 22-29 29/06A	29.06.29	200'000	0	0	200'000	101.04	202'074.00	0.42
AMAG LEASING AG 2.73 23-26 04/09A	04.09.26	250'000	0	0	250'000	101.81	254'512.50	0.53

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %	
Anleihen									
AMAG LEASING AG 3.012 23-29 04/09A	04.09.29	250'000	0	0	250'000	104.67	261'665.00	0.54	
AXPO HLDG 1.75 16-24 29/05A	29.05.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00	
AXPO HOLDING AG 2.5 23-26 22/09A	22.09.26	250'000	0	0	250'000	102.08	255'206.25	0.53	
BALOISE 2.2 23-32 30/01A	30.01.32	350'000	0	0	350'000	105.16	368'046.00	0.77	
BANK JULIUS BAER CO 0.125 21-28 27/04A	27.04.28	250'000	0	0	250'000	94.74	236'851.25	0.49	
BANQ CANTONALE 0.1000 21-31 18/04A	18.04.31	250'000	0	0	250'000	92.52	231'305.00	0.48	
BANQUE CLER EX BANQUE 0.375 19- 27 26/04A	26.04.27	100'000	0	0	100'000	97.30	97'298.00	0.20	
BC BERNOISE 0.4 18-27 03/05A	03.05.27	250'000	0	0	250'000	97.57	243'921.25	0.51	
BELL AG 0.625 16-25 24/03A	24.03.25	250'000	0	0	250'000	99.33	248'327.50	0.52	
BQ CANTONALE DE 0.1250 19-26 23/04A	23.04.26	200'000	0	0	200'000	97.92	195'839.00	0.41	
CEMBRA MONEY BA 0.4175 21-28 15/11A	15.11.28	150'000	100'000	0	250'000	95.28	238'193.75	0.50	
CEMBRA MONEY BANK AG 2.4113 23- 29 08/08A	08.08.29	250'000	0	0	250'000	103.12	257'810.00	0.54	
CIE SUISSE REASSURANCE 0.75 15-27 21/01A	21.01.27	250'000	0	0	250'000	99.19	247'986.25	0.52	
COOP-GRUPPE 0.50 16-26 19/05A	19.05.26	200'000	0	0	200'000	98.49	196'970.00	0.41	
COOP GRUPPE GEN 0.75 18-25 06/06A	06.06.25	250'000	0	0	250'000	99.40	248'498.75	0.52	
EMMI FINANZ AG 2.0 23-28 22/09A	22.09.28	250'000	0	0	250'000	102.88	257'205.00	0.54	
FCA CAPITAL SUISSE 2.9025 23-26 20/07A	20.07.26	100'000	0	0	100'000	102.22	102'219.50	0.21	
FERRING 2.25 24-29 28/06A	28.06.29	0	250'000	0	250'000	101.77	254'426.25	0.53	
GALENICA AG 1.00 17-26 15/12A	15.12.26	100'000	0	0	100'000	99.16	99'163.50	0.21	
GRANDE DIXENCE 1.7 22-29 12/07A	12.07.29	100'000	0	0	100'000	101.14	101'140.00	0.21	
INSELSPITAL-STIFTUNG 2.375 23-31 29/09A	29.09.31	250'000	0	0	250'000	105.66	264'143.75	0.55	
KRAFTWERKE LINTH L 1.25 14-24 11/09A	11.09.24	250'000	0	0	250'000	99.93	249'820.00	0.52	
KRAFTWERKE LINTH L 2.375 13-26 10/12A	10.12.26	250'000	0	0	250'000	102.36	255'893.75	0.53	
KRAFTWERKE LINTHLIMM 2.25 23-25 05/12A	05.12.25	150'000	0	0	150'000	101.17	151'759.50	0.32	
KRAFTWERKE OBERHAS 0.125 21-31 21/02A	21.02.31	150'000	0	0	150'000	92.33	138'497.25	0.29	
KRAFTWERKE OBERHASLI 1.625 24-32 16/07A	16.07.32	0	250'000	0	250'000	101.67	254'165.00	0.53	
KUEHNE NAGEL INTERN 0.20 19-25 18/06A	18.06.25	250'000	0	0	250'000	98.87	247'173.75	0.51	
MIGROS BANK 0.2500 19-27 10/12A	10.12.27	100'000	200'000	0	300'000	96.60	289'794.00	0.60	
NANT DE DRANCE SA 1.2500 20-27 25/06A	25.06.27	250'000	0	0	250'000	99.58	248'942.50	0.52	
NANT DE FRANCE 2.00 16-26 02/02A	02.02.26	250'000	0	0	250'000	100.85	252'122.50	0.52	
NESTLE 1.625 22-25 07/11A	07.11.25	500'000	0	0	500'000	100.59	502'935.00	1.05	
NESTLE 1.625 22-26 15/07A	15.07.26	250'000	0	0	250'000	100.96	252'401.25	0.53	
NESTLE 1.625 23-27 20/11A	20.11.27	250'000	0	0	250'000	101.62	254'056.86	0.53	
NESTLE 1.875 23-31 20/11A	20.11.31	250'000	0	0	250'000	104.33	260'814.23	0.54	
NESTLE 2.125 22-30 15/07A	15.07.30	250'000	0	0	250'000	105.40	263'506.25	0.55	
NESTLE 2.25 22-29 08/11A	08.11.29	500'000	0	0	500'000	105.50	527'520.00	1.10	
NESTLE 2.5 22-34 14/07A	14.07.34	250'000	0	0	250'000	110.78	276'948.75	0.58	
NESTLE LTD. 1.875 23-29 28/06A	28.06.29	500'000	0	0	500'000	103.36	516'787.50	1.08	
NESTLE LTD 0.75 18-19 28/06A	28.06.28	750'000	0	250'000	500'000	98.69	493'467.50	1.03	
NOVARTIS AG 0.25 15-25 13/05A	13.05.25	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00	
NOVARTIS AG 1.05 15-35 11/05A	11.05.35	250'000	0	0	250'000	97.86	244'657.50	0.51	
NOVARTIS AG 1.6 24-27 18/06A	18.06.27	0	250'000	0	250'000	101.43	253'567.50	0.53	
NOVARTIS AG 1.65 24-31 18/06A	18.06.31	0	250'000	0	250'000	102.74	256'837.50	0.53	

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
NOVARTIS AG 1.85 24-40 18/06A	18.06.40	0	150'000	0	150'000	105.55	158'328.00	0.33
RAIFFEISEN SCHWEIZ 0.30 16-25 22/04A	22.04.25	250'000	0	0	250'000	99.17	247'926.25	0.52
RAIFFEISEN SCHWEIZ 0.75 16-31 22/04A	22.04.31	250'000	0	0	250'000	95.30	238'242.50	0.50
RAIFFEISEN SUISSE 0.35 18-24 16/02A	16.02.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
ROCHE KAPITALMA 0.5000 22-27 25/02A	25.02.27	250'000	0	0	250'000	98.34	245'860.00	0.51
ROCHE KAPITALMARKT A 1.0 22-37 25/02A	25.02.37	150'000	0	0	150'000	95.56	143'345.25	0.30
ROCHE KAPITALMARKT A 1.6 23-28 15/09A	15.09.28	300'000	0	0	300'000	101.99	305'964.00	0.64
ROCHE KAPITALMARKT A 1.75 23-33 15/09A	15.09.33	350'000	0	0	350'000	104.25	364'861.00	0.76
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.25 18-25 24/09A	24.09.25	500'000	0	350'000	150'000	98.89	148'341.75	0.31
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.75 18-30 24/09A	24.09.30	500'000	0	0	500'000	97.74	488'702.50	1.02
ROCH KA 1.5 22-26 23/06A	23.06.26	350'000	0	0	350'000	100.68	352'388.75	0.73
ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	23.09.32	500'000	0	0	500'000	106.23	531'152.50	1.11
ROMANDE ENERGIE 2.625 22-37 15/07A	15.07.37	150'000	0	0	150'000	113.97	170'958.00	0.36
SANDOZ GROUP 2.125 23-26 17/11A	17.11.26	250'000	0	0	250'000	101.75	254'362.50	0.53
SANDOZ GROUP 2.6 23-31 17/11A	17.11.31	250'000	0	0	250'000	105.98	264'955.00	0.55
SIX GROUP AG 0.2000 21-29 28/09A	28.09.29	250'000	0	0	250'000	94.29	235'713.75	0.49
SWISSCOM 1.00 15-35 17/04A	17.04.35	250'000	0	0	250'000	95.16	237'896.25	0.50
SWISSCOM AG 0.375 17-27 31/05A	31.05.27	250'000	0	0	250'000	97.74	244'358.75	0.51
SWISSCOM AG 0.7500 18-28 12/10A	12.10.28	250'000	0	0	250'000	97.97	244'930.00	0.51
SWISSGRID AG 0.05 21-33 30/06A	30.06.33	100'000	0	0	100'000	89.55	89'554.50	0.19
SWISSGRID AG 1.625 13-25 30/01A	30.01.25	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
SWISS LIFE 2.2588 23-28 26/07A	26.07.28	300'000	0	0	300'000	103.63	310'881.00	0.65
SWISS LIFE 2.61 23-32 26/01A	26.01.32	200'000	0	0	200'000	108.09	216'182.00	0.45
SWISS PRIME SIT 0.3750 21-28 11/02A	11.02.28	250'000	0	0	250'000	96.05	240'127.50	0.50
SWISS PRIME SIT 0.65 20-29 18/12A	18.12.29	250'000	0	0	250'000	95.19	237'962.50	0.50
SWISS PRIME SIT 1.2500 19-27 02/04A	02.04.27	250'000	0	0	250'000	99.42	248'537.50	0.52
SWISS PRIME SITE A 0.825 17-26 11/05A	11.05.26	250'000	0	0	250'000	98.85	247'135.00	0.51
UBS GROUP INC 1.25 16-26 23/02A	23.02.26	200'000	0	0	200'000	99.64	199'285.00	0.41
ZURICH CIE ASS. 0.5 18-24 18/12A	18.12.24	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00
ZURICH COMPAGNIE D'ASSUR 1 18-28 30/10A	30.10.28	250'000	0	0	250'000	99.38	248'453.75	0.52
ZURICH INSURANCE 0.75 19-27 24/01A	22.10.27	250'000	0	0	250'000	98.91	247'281.25	0.51
Schweiz							18'218'157.34	37.91
APPLE INC 0.375 15-24 25/11A	25.11.24	200'000	0	0	200'000	99.77	199'534.00	0.42
AT&T INC 1.375 14-24 04/12A	04.12.24	250'000	0	0	250'000	100.07	250'185.00	0.52
COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A	02.10.28	500'000	0	0	500'000	100.20	501'020.00	1.04
ELI LILLY & CO 0.45 16-28 24/01A	24.05.28	250'000	0	0	250'000	97.94	244'847.50	0.51
EQUINIX EUROPE 1 2.875 23-28 12/09A	12.09.28	250'000	0	0	250'000	104.32	260'796.25	0.54
GOLDMAN SACHS GROUP 0.500 17-24 04/12A	04.12.24	250'000	0	0	250'000	99.68	249'196.25	0.52
GOLDMAN SACHS GROUP 1.0000 18- 25 24/11A	24.11.25	250'000	0	0	250'000	99.53	248'816.25	0.52

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
JPMORGAN CHASE CO 0.45 16-26 11/11A	11.11.26	250'000	0	0	250'000	98.28	245'696.25	0.51
MCDONALD S CORP 0.17 16-24 04/10A	04.10.24	250'000	0	0	250'000	99.75	249'366.25	0.52
NESTLE HOLDINGS INC 0.25 17-27 04/10A	04.10.27	500'000	0	100'000	400'000	97.48	389'928.00	0.81
NEW YORK LIFE G 0.1250 21-30 23/07A	23.07.30	250'000	0	0	250'000	92.79	231'972.50	0.48
NEW YORK LIFE GLB 0.125 20-29 11/09A	11.09.29	250'000	0	0	250'000	93.99	234'975.00	0.49
VERIZON COMM 1 17-27 30/11A	30.11.27	250'000	0	0	250'000	98.91	247'283.75	0.51
WELLS FARGO 1.25 14-24 03/09S	03.09.24	250'000	0	0	250'000	100.00	250'003.75	0.52
WELLS FARGO AND CO 0.75 20-25 27/05A	27.05.25	300'000	0	0	300'000	99.43	298'290.00	0.62
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							4'101'910.75	8.54
Schweizer Franken							33'485'700.84	69.69
Die an einer Börse gehandelt Effekten							33'485'700.84	69.69
Anleihen							33'485'700.84	69.69
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere							33'485'700.84	69.69

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anteile in Investmentfonds							
CON DBX USD COR -1D- USD	60'000	57'000	0	117'000	12.63	1'327'836.36	2.76
ISHARES PLC-ISHARES USD CORP BOND UCIT	150'000	0	0	150'000	5.73	772'866.16	1.61
<i>Irland</i>						2'100'702.52	4.37
SPDR PORTFOLIO CORPORATE BOND ETF	25'000	0	25'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						0.00	0.00
Dollar Us						2'100'702.52	4.37
ISHARES CORE EUR CORP BD EUR ETF	150'000	62'171	0	212'171	5.00	1'020'634.76	2.12
SSGA SPDR BLOOM BARCLAYS EU CORPO BD	14'000	0	0	14'000	52.76	711'401.18	1.48
<i>Irland</i>						1'732'035.94	3.60
DB X-T II IBOX LIQ CORP -IC	5'000	0	0	5'000	151.54	729'678.91	1.52
<i>Luxemburg</i>						729'678.91	1.52
Euro						2'461'714.85	5.12
UBS - BARCLAYS MSCI US LIQUID CORP SUST	411'000	0	0	411'000	11.12	4'569'498.00	9.51
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	374'000	0	22'282	351'718	12.83	4'511'662.65	9.39
<i>Luxemburg</i>						9'081'160.65	18.90
Schweizer Franken						9'081'160.65	18.90
Die an einer Börse gehandelt Effekten						13'643'578.02	28.39
Anteile in Investmentfonds						13'643'578.02	28.39

Titelbezeichnung	Verkehrswert CHF	in %
Bankguthaben		
Sichtguthaben	616'229.57	1.28
Bankguthaben	616'229.57	1.28

Devisenkurs

1 EUR	=	CHF	0.96305
1 USD	=	CHF	0.89858

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹		Anzahl Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	Thesaurierung des Nettoertrags je Anteil
31.12.22	Klasse A1	CHF	89.50	38'228.333	3'421'305.78	0.4723
31.12.23	Klasse A1	CHF	92.70	38'228.333	3'543'631.55	0.9266
28.06.24	Klasse A1	CHF	93.22	38'228.333	3'563'472.58	0.00
31.12.22	Klasse A2	CHF	88.81	117'983.894	10'477'591.48	0.1978
31.12.23	Klasse A2	CHF	91.80	117'983.894	10'831'150.10	0.6493
28.06.24	Klasse A2	CHF	92.27	117'983.894	10'886'844.54	0.00
31.12.22	Klasse H1	CHF	89.87	312'255.334	28'061'823.18	0.6112
31.12.23	Klasse H1	CHF	93.17	312'255.334	29'093'413.23	1.0674
28.06.24	Klasse H1	CHF	93.71	312'255.334	29'262'984.21	0.00
31.12.22	Klasse R1	CHF	89.50	53'247.000	4'765'581.74	0.4746
31.12.23	Klasse R1	CHF	92.70	48'954.000	4'537'971.90	0.9266
28.06.24	Klasse R1	CHF	93.22	43'352.000	4'041'174.77	0.00
31.12.22	Klasse E	CHF	90.91	10.000	909.05	0.70
31.12.23	Klasse E	CHF	94.28	10.000	942.84	1.175
28.06.24	Klasse E	CHF	94.84	10.000	948.35	0.00

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	28.06.24	31.12.23
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	8'827'963.40	8'683'650.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	40'402'927.45	38'543'781.10
Investmentfondsanteile	33'483'477.33	32'079'468.92
Strukturierte Produkte	6'592'193.88	5'541'528.61
Derivative Finanzinstrumente	-113'203.19	146'884.28
Bankguthaben		
Sichtguthaben	966'964.80	716'566.30
Sonstige Vermögenswerte	563'137.91	401'522.41
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	90'723'461.58	86'113'402.52
Andere Verbindlichkeiten	-525'992.06	-118'419.69
Ausstehende Rückkäufe	-7'634.88	0.00
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	90'189'834.64	85'994'982.83

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	85'994'982.83	91'160'451.22
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-313'937.78	-261'675.77
Saldo aus dem Anteilverkehr	639'670.77	-9'904'421.67
Gesamterfolg	3'869'118.82	5'000'629.05
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	90'189'834.64	85'994'982.83

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse A1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	156'913.383	95'720.114
Ausgegebene Anteile	0.000	61'193.269
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	156'913.383	156'913.383
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 106.21	102.01

Klasse A2

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	6'850.212	17'159.490
Ausgegebene Anteile	77'309.625	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	10'309.278
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	84'159.837	6'850.212
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 104.96	100.86

Klasse H1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	327'706.050	472'145.028
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	74'074.074	144'438.978
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	253'631.976	327'706.050
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 109.60	105.19

Klasse R1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	340'051.138	338'917.138
Ausgegebene Anteile	24'386.000	62'202.000
Zurückgenommene Anteile	18'549.000	61'068.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	345'888.138	340'051.138
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 106.22	102.02

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse E**

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	1'443.981	1'424.769
Ausgegebene Anteile	146.998	19.212
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	1'590.979	1'443.981
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 96.53	92.67

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	238'736.62	254'244.87
Erträge der Obligationen	205'411.79	385'906.05
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	137'328.04	750'486.72
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	6'256.38	13'663.82
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	19'731.01	24'786.84
Total Erträge	607'463.84	1'429'088.30
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen :		
an die Fondsleitung	-13'026.95	-28'109.04
an die Depotbank	-13'116.95	-28'259.04
an die Verwaltung	-187'248.55	-354'494.21
Prüfaufwand	-5'892.20	-11'847.00
Sonstige Aufwendungen	-1'353.38	-3'131.26
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-44'165.22	-109'011.38
Total Aufwendungen	-264'803.25	-534'851.93
Nettoertrag	342'660.59	894'236.37
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	409'086.50	-1'108'190.07
Realisierter Erfolg	751'747.09	-213'953.70
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	3'117'371.73	5'214'582.75
Gesamterfolg	3'869'118.82	5'000'629.05
<u>Synthetische TER in % : Klasse A1</u>	0.82	0.83
<u>Synthetische TER in % : Klasse A2</u>	1.09	1.13
<u>Synthetische TER in % : Klasse H1</u>	0.37	0.38
<u>Synthetische TER in % : Klasse R1</u>	0.82	0.83
<u>Synthetische TER in % : Klasse E</u>	0.52	0.53

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8.

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	0	25'000	25'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD	9'500	0	500	9'000	49.92	449'280.00	0.50
ACCELLERON INDUSTRIES AG	2'000	0	0	2'000	35.20	70'400.00	0.08
ADECCO REG.SHS	1'400	0	1'400	0	0.00	0.00	0.00
ALCON - REG SHS	3'360	0	210	3'150	80.22	252'693.00	0.28
ARYZTA	30'000	30'000	30'000	30'000	1.60	48'000.00	0.05
BACHEM HOLDING LTD SHARES	0	800	0	800	82.45	65'960.00	0.07
BALOISE HOLDING - REG SHS	400	0	0	400	158.20	63'280.00	0.07
BARRY CALLEBAUT LTD - NAMEN-AKT	40	0	40	0	0.00	0.00	0.00
BELIMO HOLDING LTD	0	120	0	120	450.60	54'072.00	0.06
BKW AG	400	0	0	400	143.30	57'320.00	0.06
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & PARTIZIPSCH	12	0	0	12	10'490.00	125'880.00	0.14
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	3'200	0	200	3'000	140.25	420'750.00	0.46
CLARIANT NAMEN AKT	3'200	0	3'200	0	0.00	0.00	0.00
DKSH HOLDING SA	0	800	800	0	0.00	0.00	0.00
DOTTIKON ES HLDG - REGISTERED SHS	0	200	0	200	253.00	50'600.00	0.06
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	70	0	0	70	736.50	51'555.00	0.06
FLUGHAFEN ZUERICH AG	250	0	250	0	0.00	0.00	0.00
GALDERMA GROUP AG	0	900	0	900	73.96	66'564.00	0.07
GALENICA SA	0	650	650	0	0.00	0.00	0.00
GEBERIT AG	200	0	0	200	530.80	106'160.00	0.12
GEORG FISCHER LTD	800	0	0	800	60.25	48'200.00	0.05
GIVAUDAN SA - REG SHS	50	0	0	50	4'260.00	213'000.00	0.23
HOLCIM LTD	4'000	0	600	3'400	79.62	270'708.00	0.30
JULIUS BAER GROUP - REG SHS	1'300	0	0	1'300	50.20	65'260.00	0.07
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	330	100	0	430	258.40	111'112.00	0.12
LOGITECH INTERNATIONAL SA - NAMEN-AKT	1'300	0	300	1'000	86.92	86'920.00	0.10
LONZA GROUP	470	0	0	470	490.40	230'488.00	0.25
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	15'900	0	1'300	14'600	91.72	1'339'112.00	1.48
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	12'800	300	1'600	11'500	96.17	1'105'955.00	1.22
PARTNERS GROUP HOLDING AG - NAMNE-AKT	140	0	0	140	1'154.00	161'560.00	0.18
ROCHE HOLDING LTD - DIVIDEND RIGHT CERT	4'350	200	350	4'200	249.50	1'047'900.00	1.16
SANDOZ GROUP AG	2'560	0	0	2'560	32.54	83'302.40	0.09
SCHINDLER HOLDING SA	400	0	0	400	225.80	90'320.00	0.10
SGS LTD	750	450	0	1'200	80.00	96'000.00	0.11
SIEGFRIED HOLDING	70	70	70	70	933.00	65'310.00	0.07
SIG GROUP PREFERENTIAL SHARE	3'000	0	0	3'000	16.45	49'350.00	0.05
SIKA - REGISTERED SHS	900	0	0	900	257.20	231'480.00	0.26
SONOVA HOLDING LTD - NAMEN-AKT	300	0	0	300	277.60	83'280.00	0.09
STRAUMANN HOLDING LTD - REG SHS	700	200	0	900	111.30	100'170.00	0.11
SWISSCOM SHS NOM	150	0	0	150	505.50	75'825.00	0.08
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	200	0	0	200	660.60	132'120.00	0.15
SWISSQUOTE GROUP HOLDING	300	0	300	0	0.00	0.00	0.00
SWISS RE - REG SHS	1'700	0	0	1'700	111.50	189'550.00	0.21
TEMENOS AG NAM.AKT	700	0	700	0	0.00	0.00	0.00
THE SWATCH GROUP	300	0	0	300	184.05	55'215.00	0.06
UBS GROUP NAMEN-AKT	19'669	0	969	18'700	26.45	494'615.00	0.55
VAT GROUP SA	200	0	0	200	509.40	101'880.00	0.11

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
ZURICH INSURANCE GROUP - REG SHS	870	0	0	870	479.10	416'817.00	0.46
<i>Schweiz</i>						8'827'963.40	9.73
Schweizer Franken						8'827'963.40	9.73
Die an einer Börse gehandelt Effekten						8'827'963.40	9.73
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						8'827'963.40	9.73
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						8'827'963.40	9.73

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
<i>Liechtenstein</i>							381'914.00	0.42
AUCKLAND COUNCIL 1.5 14-25 28/11A	28.11.25	250'000	0	0	250'000	100.51	251'262.50	0.28
AUCKLAND COUNCIL 1.56 23-29 30/11A	30.11.29	150'000	0	0	150'000	102.47	153'705.00	0.17
<i>Neuseeland</i>							404'967.50	0.45
TOYOTA MOTOR FINANCE 2.13 23-27 15/06A	15.06.27	200'000	0	0	200'000	102.25	204'497.00	0.23
VOLKSWAGEN FIN 2.4925 24-30 12/02A	12.02.30	0	200'000	0	200'000	104.12	208'231.00	0.23
WUERTH FINANCE INTL 2.1 22-26 16/11A	16.11.26	250'000	0	0	250'000	101.72	254'306.25	0.28
<i>Niederlande</i>							667'034.25	0.74
SPAREBANK 1 SMN 1.5 22-27 15/06A 15/06A	15.06.27	200'000	0	0	200'000	100.40	200'795.00	0.22
<i>Norwegen</i>							200'795.00	0.22
BAWAG BK 2.955 22-27 29/11A	29.11.27	250'000	0	0	250'000	104.30	260'738.75	0.29
OESTER.KONTROLLBK 2.875 05-30 25/02A	25.02.30	250'000	0	0	250'000	110.44	276'101.25	0.30
<i>Österreich</i>							536'840.00	0.59
ASIA DEV BK 0.875 22-29 13/09U	13.09.29	250'000	0	0	250'000	99.96	249'902.50	0.28
<i>Philippinen</i>							249'902.50	0.28
AKADEMISKA HUS 0.78 22-28 24/05A	24.05.28	250'000	0	0	250'000	98.75	246'868.75	0.27
<i>Schweden</i>							246'868.75	0.27
AARGAUISCHE KANTON 0.875 15-30 23/01A	23.01.30	250'000	0	0	250'000	98.48	246'211.25	0.27
ALLGEMEINE BAUGENOSSEN 0.25 21- 31 30/09A	30.09.31	250'000	0	0	250'000	91.91	229'766.25	0.25
AXPO HOLDING AG 2.5 23-26 22/09A	22.09.26	250'000	0	0	250'000	102.08	255'206.25	0.28
BALOISE HOLDING 0.000 19-29 25/09A	25.09.29	250'000	0	0	250'000	93.32	233'311.25	0.26
BANQUE CANTONALE DE ZU 0.75 15- 30 28/10A	28.10.30	0	100'000	0	100'000	97.46	97'463.50	0.11
BASELLANDSCHAFT 0.0100 21-33 28/01A	28.01.33	200'000	0	0	200'000	90.21	180'426.00	0.20
BASELLANDSCHAFT 0.0500 20-31 28/01A	28.01.31	250'000	0	0	250'000	92.69	231'726.25	0.26
BASELLANDSCHAFT 1.6000 22-32 13/05A	13.05.32	250'000	0	0	250'000	102.85	257'118.75	0.28
BASLER KANTONAL 0.1500 19-27 02/04A	02.04.27	150'000	0	0	150'000	97.22	145'824.75	0.16
BASLER KANTONALBAN 0.00 19-34 23/08A	23.08.34	150'000	0	0	150'000	88.29	132'437.25	0.15
BASL KA 1.75 22-29 21/09A	21.09.29	250'000	0	0	250'000	102.94	257'356.25	0.28
BELL AG 0.625 16-25 24/03A	24.03.25	100'000	0	0	100'000	99.33	99'331.00	0.11
BK CANTONALE GRISONS 0.125 18-24 29/05A	29.05.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
BQE LETTRE 2.625 11-31 16/02A	14.02.31	200'000	0	0	200'000	109.55	219'096.00	0.24

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
CANTON DE ZURICH 03/12A	1.00 12-25	03.12.25	250'000	0	0	250'000	100.02	250'041.25 0.28
CANTON DE ZURICH 01/12A	1.45 23-34	01.12.34	200'000	0	0	200'000	104.89	209'780.00 0.23
CANTON OF BERN 26/11A	0.2000 21-36	26.11.36	250'000	0	0	250'000	90.68	226'690.00 0.25
CANTON OF BERN 15/05A	1.50 13-29	15.05.29	250'000	0	0	250'000	102.71	256'772.50 0.28
CANTON OF GENEVA 24/05A	1.75 13-34	24.05.34	250'000	0	0	250'000	106.87	267'171.25 0.29
CANTON OF ZURIC 10/11A	0.0000 21-33	10.11.33	200'000	0	0	200'000	91.63	183'258.00 0.20
CEMBRA MONEY BA 19/08A	0.2850 19-27	19.08.27	250'000	0	0	250'000	96.36	240'896.25 0.27
CEMBRA MONEY BA 15/11A	0.4175 21-28	15.11.28	300'000	0	0	300'000	95.28	285'832.50 0.32
CENTRALE DE LETTRES 30/01A	0.02 20-40	30.01.40	250'000	0	0	250'000	83.31	208'268.75 0.23
CENTRLETTR	0.7 19-39 05/03A	04.03.39	150'000	0	0	150'000	93.07	139'599.75 0.15
CITY OF BERN	2.50 10-25 01/04A	01.04.25	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00 0.00
CITY OF ZURICH SWITZ 26/01A	1.30 24-47	26.01.47	0	200'000	0	200'000	105.22	210'434.00 0.23
CITY OF ZURICH SWITZ 13/06A	1.45 23-42	13.06.42	200'000	0	0	200'000	106.31	212'629.00 0.23
CITY OF ZURICH SWITZ 23/10A	1.75 23-41	23.10.41	0	200'000	0	200'000	110.98	221'966.00 0.24
CITY OF ZURICH SWITZER 26/05A	0.25 19-39	26.05.39	150'000	0	0	150'000	89.08	133'625.25 0.15
CITY OF ZURICH SWITZER 24/03A	1.35 24-45	24.03.45	0	150'000	0	150'000	105.73	158'589.75 0.17
COOP-GRUPPE GENOSSEN 27 29/09A	0.50 17-27	29.09.27	250'000	0	0	250'000	97.45	243'620.00 0.27
CORNER BANCA 14/07A	3.0 23-25	14.07.25	250'000	0	0	250'000	101.32	253'300.00 0.28
GIVAUDAN AG	2.375 23-31 23/05A	23.05.31	0	200'000	0	200'000	106.42	212'836.00 0.23
GIVAUDAN SA 07/06A	0.3750 21-30	07.06.30	100'000	0	0	100'000	95.24	95'243.50 0.10
GRAUBUNDNER KAN 07/05A	0.1000 21-31	07.05.31	250'000	0	0	250'000	92.88	232'187.50 0.26
GRAUBUNDNER KANTONAL 32 28/05A	0.375 19-32	28.05.32	150'000	0	0	150'000	93.65	140'478.00 0.15
KRAFTWERKE LINTHLIMM 05/12A	2.25 23-25	05.12.25	250'000	0	0	250'000	101.17	252'932.50 0.28
KRAFTWERKE OBERHASLI 16/07A	1.625 24-32	16.07.32	0	150'000	0	150'000	101.67	152'499.00 0.17
LAFARGE HOLC HELV FIN 26/08A	0.125 21-27	26.08.27	250'000	0	0	250'000	96.34	240'858.75 0.27
LUZERNER KANTONALBAN 19/06A	1.9 23-31	19.06.31	0	250'000	0	250'000	104.75	261'871.25 0.29
MIGROS BANK 10/12A	0.2500 19-27	10.12.27	250'000	0	0	250'000	96.60	241'495.00 0.27
NANT DE DRANCE 23/05A	0.8750 20-29	23.05.29	0	250'000	0	250'000	97.49	243'725.00 0.27
NESTLE	1.625 22-25 07/11A	07.11.25	200'000	0	0	200'000	100.59	201'174.00 0.22
NESTLE	2.0 23-33 28/06A	28.06.33	0	150'000	0	150'000	105.85	158'778.00 0.18
NESTLE	2.125 22-30 15/07A	15.07.30	250'000	0	0	250'000	105.40	263'506.25 0.29
NESTLE	2.625 22-35 08/11A	08.11.35	150'000	0	0	150'000	113.04	169'559.25 0.19
NOVARTIS 0.625 15-29 13/11A		13.11.29	250'000	0	0	250'000	97.55	243'885.00 0.27
NOVARTIS AG	1.05 15-35 11/05A	11.05.35	200'000	0	0	200'000	97.86	195'726.00 0.22
NOVARTIS AG	1.6 24-27 18/06A	18.06.27	0	250'000	0	250'000	101.43	253'567.50 0.28
NOVARTIS AG	1.65 24-31 18/06A	18.06.31	0	250'000	0	250'000	102.74	256'837.50 0.28
PFANDBRIEF	0.75 18-33 21/06A	21.06.33	250'000	0	0	250'000	96.29	240'735.00 0.27

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
PFANDBRIEF SCH KANTBK 0.625 17-35 25/01A	25.01.35	250'000	0	0	250'000	94.16	235'406.25	0.26
PFANDBRIEF SCHW 0.00 20-30 19/07A	19.07.30	250'000	0	0	250'000	93.52	233'805.00	0.26
PFANDBRIEF SCHW 0.1000 19-31 03/12A	03.12.31	250'000	0	0	250'000	92.55	231'386.25	0.26
PFANDBRIEF SCHW 0.1000 21-32 25/06A	25.06.32	100'000	0	0	100'000	91.89	91'893.00	0.10
PFANDBRIEF SCHW 0.1250 20-32 23/03A	23.03.32	250'000	0	0	250'000	92.45	231'126.25	0.25
PFANDBRIEF SCHW 0.1250 20-35 03/09A	03.09.35	250'000	0	0	250'000	88.53	221'313.75	0.24
PFANDBRIEF SCHW 0.375 17-28 24/07A	24.07.28	250'000	0	0	250'000	97.19	242'978.75	0.27
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-36 14/10A	14.10.36	250'000	0	0	250'000	88.85	222'115.00	0.24
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-38 04/08A	04.08.38	250'000	0	0	250'000	87.50	218'752.50	0.24
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17-26 20/10A	20.10.26	250'000	0	0	250'000	98.08	245'195.00	0.27
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17-27 18/01A	18.01.27	250'000	0	0	250'000	97.91	244'763.75	0.27
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 15-30 21/01	21.01.30	250'000	0	0	250'000	96.13	240'333.75	0.26
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 16-32 26/01A	26.01.32	250'000	0	0	250'000	94.37	235'913.75	0.26
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 16-43 23/09A	23.09.43	150'000	0	0	150'000	86.23	129'338.25	0.14
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.50 15-28 05/05A	05.05.28	250'000	0	0	250'000	97.80	244'500.00	0.27
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.50 16-35 05/10A	05.10.35	250'000	0	0	250'000	92.39	230'985.00	0.25
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.625 15-34 25/01A	25.01.34	250'000	0	0	250'000	94.73	236'830.00	0.26
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.625 17-37 23/01A	23.01.37	150'000	0	0	150'000	93.10	139'653.75	0.15
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.375 12-27 13/08A	13.08.27	250'000	0	0	250'000	100.89	252'230.00	0.28
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.375 22-32 09/04A	09.04.32	250'000	0	0	250'000	101.65	254'120.00	0.28
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 12-27 27/04A	27.04.27	250'000	0	0	250'000	101.18	252'938.75	0.28
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 12-28 21/01A	21.01.28	250'000	0	0	250'000	101.44	253'591.25	0.28
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 14-40 05/12A	05.12.40	200'000	0	0	200'000	104.54	209'088.00	0.23
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.75 23-43 23/12A	23.12.43	0	200'000	0	200'000	110.07	220'135.00	0.24
PFANDBRIEF SCHWEIZ 2.125 10-28 01/12A	01.12.28	300'000	0	0	300'000	104.43	313'294.50	0.35
PFANDBRIEF SCHWEIZ 2.375 11-25 27/06A	27.06.25	200'000	0	0	200'000	101.21	202'427.00	0.22
PFANDBRIEF SCHWEIZ HY 0,125 20-32 19/11A	19.11.32	250'000	0	0	250'000	91.60	228'993.75	0.25
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYP 0.00 2°-29 26/10A	26.10.29	250'000	0	0	250'000	94.33	235'832.50	0.26
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYP 0.25 20-42 06/10A	06.10.42	150'000	0	0	150'000	84.73	127'089.75	0.14
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYP 0.2522-27 15/03A	15.03.27	250'000	0	0	250'000	97.77	244'433.75	0.27
PFANDBRIEF SCHW KA 0.125 16-31 02/09A	02.09.31	250'000	0	0	250'000	93.05	232'617.50	0.26
PFANDBRIEF SCHW KA 0.375 16-28 24/10A	24.10.28	250'000	0	0	250'000	97.00	242'493.75	0.27
PFANDBRIEF SCHW KA 0.375 17-26 07/12A	07.12.26	250'000	0	0	250'000	98.28	245'691.25	0.27
PFANDBRIEF SCHW KA 0.50 16-34 30/03A	30.03.34	250'000	0	0	250'000	93.48	233'692.50	0.26

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
PFANDBRIEF SCHW KA 0.60 16-35 11/12A	11.12.35	250'000	0	0	250'000	93.37	233'430.00	0.26
PFANDBRIEF SCHW KA 0.625 15-29 16/07A	16.07.29	250'000	0	0	250'000	97.69	244'233.75	0.27
PFANDBRIEF SCHW KA 1.375 13-25 16/04A	16.04.25	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
PFANDBRIEF SCHW KA 1.50 14-29 05/02A	05.02.29	200'000	0	0	200'000	101.81	203'616.00	0.22
PFANDBRIEF SCHW KA 1.75 11-26 02/09A	02.09.26	250'000	0	0	250'000	101.38	253'438.75	0.28
PFANDBRIEF SCHW KA 2.00 10-25 30/10A	30.10.25	250'000	0	0	250'000	101.14	252'847.50	0.28
PFANDBRIEFZENTR 0.00 19-37 10/09A	10.09.37	250'000	0	0	250'000	85.04	212'593.75	0.23
PFANDBRIEFZENTRALE 0.75 18-32 01/10A	01.10.32	250'000	0	0	250'000	96.71	241'782.50	0.27
PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3 19-29 05/03A	09.04.29	150'000	0	0	150'000	96.32	144'481.50	0.16
PFANDBR SCHWEIZ HYPO 2.25 10-32 13/08A	13.08.32	250'000	0	0	250'000	108.40	271'008.75	0.30
PFBFR SCHWEIZ HYPO 0.625 17-30 18/10A	18.10.30	200'000	0	0	200'000	97.01	194'010.00	0.21
PFBFR SCHWZ HYPO 0.75 17-38 18/10A	18.10.38	250'000	0	0	250'000	94.00	234'988.75	0.26
PFBFR SCHWZ KANTBK 0.25 17-26 12/05A	12.05.26	250'000	0	0	250'000	98.41	246'033.75	0.27
PFBFR SCHWZ KANTBK 0.25 17-27 06/12A	06.12.27	250'000	0	0	250'000	97.22	243'040.00	0.27
PFBFR SCHWZ KANTBK 0.65 18-33 15/02A	15.02.33	250'000	0	0	250'000	95.67	239'168.75	0.26
ROCHE KAPITALMA 0.5000 22-27 25/02A	25.02.27	100'000	0	0	100'000	98.34	98'344.00	0.11
ROCHE KAPITALMA 0.7500 22-31 25/02A	25.02.31	100'000	0	0	100'000	97.31	97'308.00	0.11
ROCHE KAPITALMARKT 0.45 17-29 23/03A	23.03.29	100'000	0	0	100'000	97.00	96'998.00	0.11
ROCHE KAPITALMARKT A 1.6 23-28 15/09A	15.09.28	200'000	0	200'000	0	0.00	0.00	0.00
ROCHE KAPITALMARKT A 1.75 23-33 15/09A	15.09.33	200'000	0	0	200'000	104.25	208'492.00	0.23
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.25 18-25 24/09A	24.09.25	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
ROCH KA 1.5 22-26 23/06A	23.06.26	100'000	0	0	100'000	100.68	100'682.50	0.11
ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	23.09.32	100'000	0	0	100'000	106.23	106'230.50	0.12
SANDOZ GROUP 2.125 23-26 17/11A	17.11.26	250'000	0	0	250'000	101.75	254'362.50	0.28
SIX GROUP AG 0.125 21-26 27/11A	27.11.26	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
STADLER RAIL AG 0.375 19-26 20/11A	20.11.26	250'000	0	0	250'000	97.25	243'128.75	0.27
ST COOP CENT D'EMI 1.70 23-41 29/04A	29.04.41	330'000	0	0	330'000	110.78	365'587.20	0.40
SWISSGRID AG 1.625 13-25 30/01A	30.01.25	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
SWITZERLAND 0.00 16-29 22/06U	22.06.29	400'000	0	0	400'000	97.03	388'100.00	0.43
SWITZERLAND 0.25 21-35 23/06A	23.06.35	200'000	0	0	200'000	97.01	194'019.00	0.21
SWITZERLAND 0.5000 18-32 27/06A	27.06.32	250'000	0	0	250'000	99.63	249'071.25	0.27
SWITZERLAND 0.50 15-30 27/05A	27.05.30	350'000	0	0	350'000	99.63	348'720.75	0.38
SWITZERLAND 0.5 16-58 30/05A	30.05.58	100'000	0	0	100'000	100.38	100'384.00	0.11
SWITZERLAND 0.5 17-45 28/06A	28.06.45	250'000	0	0	250'000	99.08	247'711.25	0.27
SWITZERLAND 0.5 17-55 24/05A	24.05.55	100'000	0	0	100'000	99.66	99'656.00	0.11
SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	26.06.34	200'000	0	0	200'000	94.85	189'709.00	0.21
SWITZERLAND 0 19-39 24/07U	24.07.39	250'000	0	0	250'000	92.31	230'786.25	0.25
SWITZERLAND 1.25 12-37 27/06A	27.06.37	450'000	0	0	450'000	109.09	490'887.00	0.54
SWITZERLAND 1.25 14-26 28/05A	28.05.26	350'000	0	0	350'000	100.95	353'332.00	0.39
SWITZERLAND 1.50 12-42 30/04A	30.04.42	500'000	0	0	500'000	116.17	580'850.00	0.64
SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	24.07.25	300'000	0	0	300'000	100.65	301'942.50	0.33

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
SWITZERLAND 2.25 11-31 22/06A	22.06.31	300'000	0	0	300'000	111.65	334'948.50	0.37
SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	08.03.36	400'000	0	0	400'000	122.43	489'726.00	0.54
SWITZERLAND 3.25 07-27 27/06A	27.06.27	250'000	0	0	250'000	107.62	269'056.25	0.30
SWITZERLAND 3.50 03-33 08/04A	08.04.33	400'000	0	0	400'000	125.35	501'398.00	0.55
SWITZERLAND 4.00 98-28 08/04A	08.04.28	500'000	0	0	500'000	112.47	562'340.00	0.62
SWITZERLAND 4.00 99-49 06/01A	06.01.49	200'000	0	0	200'000	179.33	358'663.00	0.40
SWITZERLAND GOVERNME 0.875 24-47 22/05A	22.05.47	0	250'000	0	250'000	106.76	266'900.00	0.29
VILLE DE GENEVE 1.6 23-33 06/12A	06.12.33	250'000	0	0	250'000	104.32	260'796.25	0.29
ZUERCHER KANTON 0.0000 20-30 12/03A	12.03.30	350'000	0	0	350'000	93.64	327'743.50	0.36
ZUERCHER KANTON 1.4000 22-29 25/07A	25.07.29	250'000	0	0	250'000	101.27	253'186.25	0.28
ZUERCHER KANTONALB 0.25 17-26 27/01A	27.01.26	250'000	0	0	250'000	98.52	246'310.00	0.27
ZUGER KANTONALB 0.1000 20-31 14/10A	14.10.31	250'000	0	0	250'000	92.32	230'797.50	0.25
ZURICH 0.75 22-31 25/04A	25.04.31	0	250'000	0	250'000	98.73	246'818.75	0.27
<i>Schweiz</i>							30'880'263.45	34.04
SLOVAKIA GOVERNMENT 1.5225 24-28 10/05A	10.05.28	0	100'000	0	100'000	100.69	100'690.00	0.11
<i>Slowakei</i>							100'690.00	0.11
SANTANDER CONSUMER F 2.7325 23-25 04/07A	04.07.25	250'000	0	0	250'000	101.30	253'260.00	0.28
<i>Spanien</i>							253'260.00	0.28
KOREA HOU FINANCE 2.155 22-25 14/10A	14.10.25	250'000	0	150'000	100'000	101.12	101'119.50	0.11
KOREA NATIONAL OIL 0.875 20-25 21/04A	21.04.25	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Südkorea</i>							101'119.50	0.11
APPLE INC 0.375 15-24 25/11A	25.11.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
EQUINIX EUROPE 1 2.875 23-28 12/09A	12.09.28	250'000	0	0	250'000	104.32	260'796.25	0.29
NESTLE HOLDINGS INC 0.55 17-32 04/10A	04.10.32	0	250'000	0	250'000	95.41	238'515.00	0.26
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							499'311.25	0.55
Schweizer Franken							40'148'116.20	44.25
Die an einer Börse gehandelt Effekten							40'148'116.20	44.25
BFCM 0.366 18-24 10/10A	10.10.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Frankreich</i>							0.00	0.00
Schweizer Franken							0.00	0.00
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelt, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden							0.00	0.00
PFANDBRIEFZENTRALE SC 1.45 22-30 30/04A	30.04.30	250'000	0	0	250'000	101.92	254'811.25	0.28

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
<i>Schweiz</i>							254'811.25	0.28
Schweizer Franken							254'811.25	0.28
Übertragbare Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind und nach am Markt beobachtbaren Parametern bewertet werden							254'811.25	0.28
Anleihen							40'402'927.45	44.53
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere							40'402'927.45	44.53

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anteile in Investmentfonds							
ISHARES CORE MSCI EM IMI UCITS ETF	28'500	0	10'200	18'300	34.31	564'192.30	0.62
ISHARES III ISHARES CORE MSCI WLD UCITS	27'400	0	16'200	11'200	101.98	1'026'333.19	1.13
ISHARES JP MORGAN EM LOC GOVT BD UCITS D	102'600	10'000	0	112'600	43.32	4'382'602.20	4.83
SPDR MSCI WORLD UCITS ETF	0	6'000	0	6'000	37.27	200'939.81	0.22
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	2'200	0	2'200	0	0.00	0.00	0.00
UBS IRL ETF PLC MSCI WORLD UCETF USD AC	0	1	0	1	31.72	28.50	0.00
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	44'000	0	0	44'000	11.80	466'343.54	0.51
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	1'890	0	0	1'890	56.56	96'056.45	0.11
<i>Irland</i>						6'736'495.99	7.43
SPDR S&P500 ETF TRUST	700	0	700	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						0.00	0.00
Dollar Us						6'736'495.99	7.43
ISHARES COR GLO AGGRE BOND-H ACC CHF ETF	798'000	100'000	0	898'000	4.53	4'064'797.00	4.48
SPDR BLOOMBERG BARCLAYS GBL AGG BDHDG	93'500	0	0	93'500	27.20	2'543'574.00	2.80
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	47'040	0	0	47'040	100.42	4'723'756.80	5.21
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1D	2'000	2'500	0	4'500	85.18	383'310.00	0.42
<i>Irland</i>						11'715'437.80	12.91
DBXT2 GLOB AGG-4C- CAP ETF	153'000	0	0	153'000	15.27	2'336'692.50	2.58
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	309'750	23'252	0	333'002	12.83	4'271'583.16	4.71
<i>Luxemburg</i>						6'608'275.66	7.28
ISHARES SWISS DIVIDEND ETF (CH) ANTEILEA	0	1	0	1	158.26	158.26	0.00
ISHS CORE SPIE ETF -A-	0	2'800	0	2'800	144.28	403'984.00	0.45
SWISSINVEST RE INV	970	0	970	0	0.00	0.00	0.00
UBS SXI RE FD - ANTEILE -(CHF) A- DIS-	0	92'000	0	92'000	9.08	835'728.00	0.92
ZKB GOLD ETF -A CHF-	850	0	0	850	623.90	530'315.00	0.58
<i>Schweiz</i>						1'770'185.26	1.95
Schweizer Franken						20'093'898.72	22.15
Die an einer Börse gehandelt Effekten						26'830'394.71	29.57
AMUNDI MSCI WORLD ETF DR USD A	0	1	0	1	127.21	114.31	0.00
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	9'524	0	0	9'524	120.87	1'034'386.17	1.14
<i>Irland</i>						1'034'500.48	1.14
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	72	0	0	72	15'362.49	993'915.48	1.10
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	400	0	0	400	1'405.62	505'223.17	0.56

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
MS INV F GLOBAL CONVERT BOND Z ACC	20'700	0	0	20'700	49.63	923'145.09	1.02
<i>Luxemburg</i>						2'422'283.74	2.67
Dollar Us						3'456'784.22	3.81
UBS EUR EQUIT DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	1'700	0	1'700	0	0.00	0.00	0.00
<i>Irland</i>						0.00	0.00
Euro						0.00	0.00
CSIMF SWISS REAL ESTATE SECURITIES EB	720	400	0	1'120	1'899.87	2'127'854.40	2.35
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	21'865	0	11'972	9'893	108.00	1'068'444.00	1.18
<i>Schweiz</i>						3'196'298.40	3.52
Schweizer Franken						3'196'298.40	3.52
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden						6'653'082.62	7.33
Anteile in Investmentfonds						33'483'477.33	36.91

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung		Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Strukturierte Produkte									
SG ISSUER CV	0.00 23-24 11/12A	11.12.24	8'600	0	0	8'600	432.10	3'339'166.39	3.68
<i>Luxemburg</i>								3'339'166.39	3.68
Dollar Us								3'339'166.39	3.68
Die an einer Börse gehandelt Effekten								3'339'166.39	3.68
UBS LONDON PERLES 2013 31/12U	13-XX	31.12.99	8'383	0	0	8'383	431.85	3'253'027.49	3.59
<i>Großbritannien</i>								3'253'027.49	3.59
Dollar Us								3'253'027.49	3.59
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden								3'253'027.49	3.59
Strukturierte Produkte								6'592'193.88	7.27

Inventar des Vermögens

	Verfall	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verkehrswert CHF	in %
Derivative Finanzinstrumente							
Devisentermingeschäfte ¹							
	15.11.24	1'243'260.20	CHF	1'400'000.00	USD	5'677.93	0.01
	12.08.24	2'706'577.92	CHF	3'160'000.00	USD	-118'881.12	-0.13
	15.05.24	1'241'300.20	CHF	1'400'000.00	USD	0.00	0.00
	12.02.24	2'714'857.12	CHF	3'160'000.00	USD	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte						-113'203.19	-0.12
Derivative Finanzinstrumente						-113'203.19	-0.12

¹ Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zuercher Kantonalbank

Titelbezeichnung	Verkehrswert CHF	in %
Bankguthaben		
Sichtguthaben	966'964.80	1.07
Bankguthaben	966'964.80	1.07

Devisenkurs

1 EUR	=	CHF	0.96305
1 GBP	=	CHF	1.13587
1 USD	=	CHF	0.89858

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen	
Devisentermingeschäfte	4'063'041.31
Total in CHF	4'063'041.31
Total in % des Nettofondsvermögens	4.50

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹		Anzahl Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	Thesaurierung des Nettoertrags je Anteil
31.12.22	Klasse A1	CHF	97.14	95'720.114	9'298'097.33	0.5582
31.12.23	Klasse A1	CHF	102.01	156'913.383	16'006'338.73	0.8834
28.06.24	Klasse A1	CHF	106.21	156'913.383	16'665'062.72	0.00
31.12.22	Klasse A2	CHF	96.23	17'159.490	1'651'322.33	0.2522
31.12.23	Klasse A2	CHF	100.86	6'850.212	690'929.81	0.5778
28.06.24	Klasse A2	CHF	104.96	84'159.837	8'833'721.91	0.00
31.12.22	Klasse H1	CHF	99.89	472'145.028	47'160'211.08	1.0520
31.12.23	Klasse H1	CHF	105.19	327'706.050	34'472'289.19	1.3723
28.06.24	Klasse H1	CHF	109.60	253'631.976	27'798'175.57	0.00
31.12.22	Klasse R1	CHF	97.15	338'917.138	32'925'323.24	0.5566
31.12.23	Klasse R1	CHF	102.02	340'051.138	34'691'607.55	0.8835
28.06.24	Klasse R1	CHF	106.22	345'888.138	36'739'293.15	0.00
31.12.22	Klasse E	CHF	88.08	1'424.769	125'497.24	0.7919
31.12.23	Klasse E	CHF	92.67	1'443.981	133'817.55	1.0735
28.06.24	Klasse E	CHF	96.53	1'590.979	153'581.29	0.00

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	28.06.24	31.12.23
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	26'804'518.60	25'205'193.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	55'724'306.61	51'396'019.57
Investmentfondsanteile	79'881'860.55	76'062'197.72
Strukturierte Produkte	20'460'965.69	17'142'216.95
Derivative Finanzinstrumente	-177'376.67	363'570.60
Bankguthaben		
Sichtguthaben	1'990'100.10	1'517'265.71
Collateral	100'000.00	100'000.00
Sonstige Vermögenswerte	2'801'501.28	682'934.48
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	187'585'876.16	172'469'398.93
Andere Verbindlichkeiten	-2'591'711.29	-388'579.20
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	184'994'164.87	172'080'819.73

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	172'080'819.73	160'747'912.58
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-566'349.15	-454'303.36
Saldo aus dem Anteilverkehr	3'092'081.64	3'680'841.18
Gesamterfolg	10'387'612.65	8'106'369.33
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	184'994'164.87	172'080'819.73

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse A1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	725'022.319	626'857.992
Ausgegebene Anteile	93'449.210	98'164.327
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	818'471.529	725'022.319
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 110.78	104.82

Klasse A2

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	707'680.572	807'232.588
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	95'029.934	99'552.016
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	612'650.638	707'680.572
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 108.83	103.12

Klasse H1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	10.000	10.000
Ausgegebene Anteile	0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	10.000	10.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 116.38	109.85

Klasse R1

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	217'189.216	182'786.216
Ausgegebene Anteile	41'655.000	62'910.000
Zurückgenommene Anteile	13'433.000	28'507.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	245'411.216	217'189.216
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 110.86	104.89

Entwicklung der Anzahl der Anteile**Klasse E**

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode	3'530.407	2'163.222
Ausgegebene Anteile	959.835	1'367.185
Zurückgenommene Anteile	0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode	4'490.242	3'530.407
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF 97.49	92.08

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	686'531.08	716'259.44
Erträge der Obligationen	307'394.62	489'368.49
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	277'423.23	1'602'075.62
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	14'319.63	29'361.42
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	13'979.19	25'600.75
Total Erträge	1'299'647.75	2'862'665.72
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen :		
an die Fondsleitung	-26'533.08	-50'237.12
an die Depotbank	-26'653.08	-50'402.12
an die Verwaltung	-719'548.91	-1'393'474.16
Prüfaufwand	-5'892.20	-11'847.00
Passivzinsen	0.00	-1'145.85
Sonstige Aufwendungen	-1'353.38	-3'190.26
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-4'521.10	-12'863.82
Total Aufwendungen	-784'501.75	-1'523'160.33
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds ¹	0.00	262'570.23
Nettoertrag	515'146.00	1'602'075.62
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2'413'149.68	-2'574'775.48
Realisierter Erfolg	2'928'295.68	-972'699.86
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	7'459'316.97	9'079'069.19
Gesamterfolg	10'387'612.65	8'106'369.33
<u>Synthetische TER in % : Klasse A1</u>	0.93	0.95
<u>Synthetische TER in % : Klasse A2</u>	1.22	1.25
<u>Synthetische TER in % : Klasse H1</u>	0.44	0.47
<u>Synthetische TER in % : Klasse R1</u>	0.92	0.95
<u>Synthetische TER in % : Klasse E</u>	0.58	0.60

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8.

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	0	75'000	75'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD	27'000	0	0	27'000	49.92	1'347'840.00	0.72
ACCELLERON INDUSTRIES AG	6'000	0	0	6'000	35.20	211'200.00	0.11
ADECCO REG.SHS	4'000	0	4'000	0	0.00	0.00	0.00
ALCON - REG SHS	9'500	0	0	9'500	80.22	762'090.00	0.41
ARYZTA	90'000	90'000	90'000	90'000	1.60	144'000.00	0.08
BACHEM HOLDING LTD SHARES	0	2'400	0	2'400	82.45	197'880.00	0.11
BALOISE HOLDING - REG SHS	1'400	0	0	1'400	158.20	221'480.00	0.12
BARRY CALLEBAUT LTD - NAMEN-AKT	120	0	120	0	0.00	0.00	0.00
BELIMO HOLDING LTD	0	340	0	340	450.60	153'204.00	0.08
BKW AG	1'200	0	0	1'200	143.30	171'960.00	0.09
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING	0	220	0	220	590.00	129'800.00	0.07
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	35	0	0	35	10'490.00	367'150.00	0.20
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	9'100	0	0	9'100	140.25	1'276'275.00	0.68
CLARIANT NAMEN AKT	9'600	0	9'600	0	0.00	0.00	0.00
DKSH HOLDING SA	0	2'300	0	2'300	60.70	139'610.00	0.07
DOTTIKON ES HLDG - REGISTERED SHS	0	600	0	600	253.00	151'800.00	0.08
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	200	0	0	200	736.50	147'300.00	0.08
FLUGHAFEN ZUERICH AG	750	0	750	0	0.00	0.00	0.00
GALDERMA GROUP AG	0	2'500	0	2'500	73.96	184'900.00	0.10
GALENICA SA	0	1'800	1'800	0	0.00	0.00	0.00
GEBERIT AG	550	0	0	550	530.80	291'940.00	0.16
GEORG FISCHER LTD	2'400	0	0	2'400	60.25	144'600.00	0.08
GIVAUDAN SA - REG SHS	160	0	0	160	4'260.00	681'600.00	0.36
HOLCIM LTD	12'000	0	1'500	10'500	79.62	836'010.00	0.45
JULIUS BAER GROUP - REG SHS	4'400	0	0	4'400	50.20	220'880.00	0.12
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	1'200	300	250	1'250	258.40	323'000.00	0.17
LOGITECH INTERNATIONAL SA - NAMEN-AKT	3'300	0	0	3'300	86.92	286'836.00	0.15
LONZA GROUP	1'400	0	0	1'400	490.40	686'560.00	0.37
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	45'200	0	900	44'300	91.72	4'063'196.00	2.17
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	36'200	0	1'300	34'900	96.17	3'356'333.00	1.79
PARTNERS GROUP HOLDING AG - NAMNE-AKT	400	0	0	400	1'154.00	461'600.00	0.25
ROCHE HOLDING LTD - DIVIDEND RIGHT CERT	12'200	600	0	12'800	249.50	3'193'600.00	1.70
SANDOZ GROUP AG	7'240	0	0	7'240	32.54	235'589.60	0.13
SCHINDLER HOLDING SA	950	0	0	950	225.80	214'510.00	0.11
SGS LTD	2'250	1'350	0	3'600	80.00	288'000.00	0.15
SIEGFRIED HOLDING	200	200	200	200	933.00	186'600.00	0.10
SIG GROUP PREFERENTIAL SHARE	11'000	0	0	11'000	16.45	180'950.00	0.10
SIKA - REGISTERED SHS	2'600	0	0	2'600	257.20	668'720.00	0.36
SONOVA HOLDING LTD - NAMEN-AKT	700	0	0	700	277.60	194'320.00	0.10
STRAUMANN HOLDING LTD - REG SHS	2'300	600	300	2'600	111.30	289'380.00	0.15
SWISSCOM SHS NOM	450	0	0	450	505.50	227'475.00	0.12
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	750	0	150	600	660.60	396'360.00	0.21
SWISSQUOTE GROUP HOLDING	850	0	850	0	0.00	0.00	0.00
SWISS RE - REG SHS	4'700	0	0	4'700	111.50	524'050.00	0.28
TECAN GROUP NAM.AKT	0	450	0	450	300.80	135'360.00	0.07
TEMENOS AG NAM.AKT	3'500	0	3'500	0	0.00	0.00	0.00

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
THE SWATCH GROUP	900	0	0	900	184.05	165'645.00	0.09
UBS GROUP NAMEN-AKT	55'765	0	1'265	54'500	26.45	1'441'525.00	0.77
VAT GROUP SA	600	0	0	600	509.40	305'640.00	0.16
ZÜRICH INSURANCE GROUP - REG SHS	2'500	0	0	2'500	479.10	1'197'750.00	0.64
<i>Schweiz</i>						26'804'518.60	14.29
Schweizer Franken						26'804'518.60	14.29
Die an einer Börse gehandelt Effekten						26'804'518.60	14.29
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						26'804'518.60	14.29
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						26'804'518.60	14.29

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								
Anleihen								
COMMONW BK AUSTRALIA 0.40 17-26 25/09A	25.09.26	250'000	0	0	250'000	98.29	245'712.50	0.13
CW BK AUST 1.94 23-30 26/06A	26.06.30	300'000	0	0	300'000	104.32	312'952.50	0.17
NATIONAL AUSTRALIA 0.5650 22-31 03/02A	03.02.31	0	200'000	0	200'000	95.50	190'994.00	0.10
NATIONAL AUSTRALIA B 2.201 23-29 12/04A	12.04.29	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30 17-25 31/10A	31.10.25	250'000	0	0	250'000	98.72	246'801.25	0.13
<i>Australien</i>							996'460.25	0.53
BERLIN HYP AG 0.25 20-28 11/09A	11.09.28	250'000	0	0	250'000	95.12	237'811.25	0.13
DEUTSCHE BAHN F 0.1000 21-36 28/01A	28.01.36	300'000	0	0	300'000	86.86	260'581.50	0.14
DEUTSCHE BAHN FIN 0.45 17-30 08/11A	08.11.30	250'000	0	0	250'000	95.92	239'797.50	0.13
DEUTSCHE BK PARIS BR 2.245 24-30 25/01A	25.01.30	0	200'000	0	200'000	102.91	205'815.00	0.11
DZ BANK AG DEUT 2.202 23-28 18/09A	18.09.28	250'000	0	0	250'000	102.73	256'812.50	0.14
MUENCHENER HYPO 0.0100 21-26 10/11A	10.11.26	200'000	0	0	200'000	97.30	194'596.00	0.10
MUENCHENER HYPOTHEKE 2.5 24-30 20/02	20.02.30	0	200'000	0	200'000	103.34	206'680.00	0.11
MUENCHENER HYPOTHEKEN 0.25 19- 29 26/02A	26.02.29	250'000	0	0	250'000	96.01	240'032.50	0.13
<i>Deutschland</i>							1'842'126.25	0.98
BFCM BANQUE FEDERATI 2.3 23-27 30/01A	30.01.27	250'000	0	0	250'000	102.20	255'502.50	0.14
BFCM BANQUE FEDERATI 2.73 23-30 11/07A	11.07.30	250'000	0	0	250'000	106.39	265'973.75	0.14
BNP PARIBAS 2.4125 23-28 13/01A	13.01.28	200'000	0	0	200'000	102.99	205'989.00	0.11
BNP PARIBAS SA 2.8925 22-29 27/09A27/09A	27.09.29	200'000	0	0	200'000	105.17	210'346.00	0.11
CREDIT AGRICOLE SA 3.042 22-27 29/09A09A	29.09.27	200'000	0	0	200'000	104.32	208'649.00	0.11
EDF SA 0.65 16-28 13/10A	13.10.28	200'000	0	0	200'000	95.98	191'951.00	0.10
RATP 1.512 24-36 06/03A	06.03.36	0	200'000	0	200'000	101.66	203'320.00	0.11
TOTAL CAP INT 0.50 15-27 15/06A	01.06.27	250'000	0	0	250'000	98.29	245'732.50	0.13
TOTAL CAPITAL INTL 1.00 14-24 29/08A	29.08.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Frankreich</i>							1'787'463.75	0.95
SANTANDER UK PLC 2.01 23-26 12/09A	12.09.26	250'000	0	0	250'000	101.82	254'540.00	0.14
<i>Großbritannien</i>							254'540.00	0.14
CANADA 0.25 17-29 28/06A	28.06.29	300'000	0	0	300'000	95.99	287'977.50	0.15
CIBC 0.125 15-25 22/12A	22.12.25	250'000	0	0	250'000	98.42	246'053.75	0.13
FED CAISSES DESJARDI 1.735 23-28 31/01A	31.01.28	300'000	0	0	300'000	102.09	306'255.00	0.16
PROVINCE DE QUEBEC 1.367 24-34 26/04A	26.04.34	0	250'000	0	250'000	101.83	254'566.25	0.14
PROV OF NEW BRUNSWICK 0.2 16-31 07/11A	07.11.31	250'000	0	0	250'000	93.07	232'685.00	0.12
QUEBEC (PROV.OF) 0.75 14-24 21/11A	21.11.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
QUEBEC MONTREAL 2.04 23-33 09/05A	09.05.33	150'000	0	0	150'000	107.46	161'194.50	0.09

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
ROYAL BANK OF CANADA 1.45 22-27 04/05A	04.05.27	250'000	0	0	250'000	100.07	250'172.50	0.13
TORONTO DOMINION BAN 1.4825 24- 29 30/01A	30.01.29	0	300'000	0	300'000	101.41	304'234.50	0.16
TORONTO DOMINION BAN 1.97 23-26 18/09U	18.09.26	250'000	0	0	250'000	101.72	254'305.00	0.14
<i>Kanada</i>							2'297'444.00	1.22
LGT BANK IN LIECHTE 0.20 20-30 04/11A	04.11.30	300'000	0	0	300'000	92.45	277'359.00	0.15
LGT BANK IN LIECHTE 0.375 19-28 05/07A	05.07.28	200'000	0	0	200'000	95.48	190'957.00	0.10
LGT BANK IN LIECHTEN 2.5 23-33 28/02A	28.02.33	0	250'000	0	250'000	107.20	267'992.50	0.14
<i>Liechtenstein</i>							736'308.50	0.39
BANQUE EUROP INVEST 3.375 07-27 15/10A	15.10.27	250'000	0	0	250'000	107.99	269'983.75	0.14
<i>Luxemburg</i>							269'983.75	0.14
ASB BANK 2.5025 23-28 20/12A	20.12.28	200'000	0	0	200'000	104.62	209'241.00	0.11
AUCKLAND COUNCIL 1.5 14-25 28/11A	28.11.25	500'000	0	0	500'000	100.51	502'525.00	0.27
AUCKLAND COUNCIL 1.56 23-29 30/11A	30.11.29	250'000	0	0	250'000	102.47	256'175.00	0.14
<i>Neuseeland</i>							967'941.00	0.52
ABN AMRO BK 2.3 23-25 26/06A	26.06.25	200'000	0	200'000	0	0.00	0.00	0.00
BMW INTL INVEST BV 0.75 19-27 03/09A	03.09.27	250'000	0	0	250'000	98.64	246'602.50	0.13
BNG BANK NV 1.7925 23-28 24/04A	24.04.28	0	100'000	0	100'000	102.95	102'948.00	0.05
ENBW INTL FINANCE 2.625 23-29 15/06A	15.06.29	0	100'000	0	100'000	104.65	104'650.50	0.06
TOYOTA MOTOR FINANCE 2.13 23-27 15/06A	15.06.27	200'000	0	0	200'000	102.25	204'497.00	0.11
VOLKSWAGEN FIN 2.4925 24-30 12/02A	12.02.30	0	200'000	0	200'000	104.12	208'231.00	0.11
VOLKSWAGEN FINANCIAL 2.2075 24-27 12/02A	12.02.27	0	200'000	0	200'000	101.53	203'061.00	0.11
<i>Niederlande</i>							1'069'990.00	0.57
KBN 0.545 22-28 28/04A	28.04.28	300'000	0	0	300'000	98.18	294'538.50	0.16
<i>Norwegen</i>							294'538.50	0.16
BAWAG BK 2.955 22-27 29/11A	29.11.27	250'000	0	0	250'000	104.30	260'738.75	0.14
OESTER.KONTROLLBK 2.875 05-30 25/02A	25.02.30	250'000	0	0	250'000	110.44	276'101.25	0.15
VORALBERGER LANDESUH 2.375 23- 26 04/05A	04.05.26	250'000	0	0	250'000	101.64	254'091.25	0.14
<i>Österreich</i>							790'931.25	0.42
AARGAUISCHE KANTON 0.875 15-30 23/01A	23.01.30	300'000	0	0	300'000	98.48	295'453.50	0.16
ADECCO GROUP SA 0.875 18-26 18/09A	18.09.26	150'000	0	0	150'000	99.08	148'626.75	0.08

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
AXPO HOLDING AG 2.5 23-26 22/09A	22.09.26	250'000	0	0	250'000	102.08	255'206.25	0.14
BANK JULIUS BAER 2.375 23-27 06/09A	06.09.27	0	250'000	0	250'000	102.53	256'331.25	0.14
BANK JULIUS BAER CO 0.125 21-28 27/04A	27.04.28	250'000	0	0	250'000	94.74	236'851.25	0.13
BANK JULIUS BAER CO 2.375 24-31 04/04A	04.04.31	0	100'000	0	100'000	102.76	102'761.50	0.05
BANK JULIUS BAER CO 2.5 23-30 06/09A	06.09.30	250'000	0	0	250'000	103.79	259'462.50	0.14
BANQUE CANTONALE DE BA 0.01 22- 26 28/07A	28.07.26	250'000	0	0	250'000	97.58	243'953.75	0.13
BANQUE DES LETTRES 0.125 19-30 10/12A	10.12.30	200'000	0	0	200'000	93.84	187'670.00	0.10
BANQUE DES LETTRES DE 0.25 21-32 10/03A	10.03.32	250'000	0	0	250'000	93.32	233'291.25	0.12
BARRY CALLEBAUT SA 2.3 24-32 23/01A	23.01.32	0	250'000	0	250'000	102.31	255'781.25	0.14
BASELLANDSCHAFT 0.0500 20-31 28/01A	28.01.31	350'000	0	0	350'000	92.69	324'416.75	0.17
BASELLANDSCHAFT KA 0.25 15-25 13/05A	13.05.25	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
BASL KA 1.75 22-29 21/09A	21.09.29	250'000	0	0	250'000	102.94	257'356.25	0.14
BK CANTONALE GRISONS 0.125 18-24 29/05A	29.05.24	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00
BQ CANTONALE VAUDOIS 1.50 14-24 28/03A	28.03.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
BQE LETTRE 2.625 11-31 16/02A	14.02.31	0	200'000	0	200'000	109.55	219'096.00	0.12
BQUE CANTONALE DE ZU 0.05 20-32 04/11A	04.11.32	0	250'000	0	250'000	90.83	227'065.00	0.12
BQUE LETTER 1.125 18-47 19/10A	18.10.47	200'000	0	0	200'000	99.32	198'631.00	0.11
BQUE LETTRE GAG 2.5 11-26 30/03A	30.03.26	250'000	0	0	250'000	102.38	255'942.50	0.14
CANTON DE BALEVILLE 0.00 18-25 24/09A	24.09.25	250'000	0	0	250'000	98.76	246'896.25	0.13
CANTON DE BALE-VILLE 0.5 19-34 22/02A	22.02.34	250'000	0	0	250'000	96.01	240'023.75	0.13
CANTON DE BERNE 0.625 22-35 27/03A	27.03.35	250'000	0	0	250'000	96.24	240'611.25	0.13
CANTON DE GENEVE 0.25 20-40 15/06A	15.06.40	250'000	0	0	250'000	87.63	219'068.75	0.12
CANTON DE GENEVE 2 13-26 20/03A	20.03.26	200'000	0	0	200'000	101.67	203'333.00	0.11
CANTON DE NEUCHATE 0.75 18-33 28/11A	28.11.33	250'000	0	0	250'000	97.67	244'185.00	0.13
CANTON DE ZURICH 1.00 12-25 03/12A	03.12.25	500'000	0	0	500'000	100.02	500'082.50	0.27
CANTON DE ZURICH 1.45 23-34 01/12A	01.12.34	300'000	0	0	300'000	104.89	314'670.00	0.17
CANTON OF BASLE 1.7500 13-43 26/06A	26.06.43	250'000	0	0	250'000	112.48	281'200.00	0.15
CANTON OF BASLE-LA 1.50 13-28 26/06A	26.06.28	250'000	0	0	250'000	102.29	255'735.00	0.14
CANTON OF BERN 1.50 13-29 15/05A	15.05.29	500'000	0	0	500'000	102.71	513'545.00	0.27
CANTON OF GENEV 0.3000 19-39 28/11A	28.11.39	250'000	0	0	250'000	88.98	222'448.75	0.12
CANTON OF GENEVA 1.75 13-33 22/03A	22.03.33	0	250'000	0	250'000	106.25	265'630.00	0.14
CANTON OF GENEVA 1.75 13-34 24/05A	24.05.34	400'000	0	0	400'000	106.87	427'474.00	0.23
CANTON OF VAUD 2.00 13-33 24/10A	24.10.33	0	150'000	0	150'000	109.29	163'931.25	0.09
CANTON OF ZURICH 0.1000 20-45 23/06A	23.06.45	250'000	0	0	250'000	83.39	208'475.00	0.11
CANTON OF ZURICH 1.00 14-27 06/10A	06.10.27	200'000	0	0	200'000	100.48	200'960.00	0.11
CEMBRA MONEY BA 0.4175 21-28 15/11A	15.11.28	250'000	0	0	250'000	95.28	238'193.75	0.13

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
CEMBRA MONEY BANK AG 2.4113 23-29 08/08A	08.08.29	250'000	0	0	250'000	103.12	257'810.00	0.14
CEMBRA MONEY BANK AG 3.1125 22-27 28/04A	28.04.27	0	200'000	0	200'000	104.06	208'123.00	0.11
CENTRLETTTR 0.7 19-39 05/03A	04.03.39	250'000	0	0	250'000	93.07	232'666.25	0.12
CITY OF BERN 0.625 17-39 13/06A	13.06.39	250'000	0	0	250'000	93.84	234'593.75	0.13
CITY OF BERN 2.50 10-25 01/04A	01.04.25	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00
CITY OF LAUSANN 0.3500 20-32 06/07A	06.07.32	300'000	0	0	300'000	94.66	283'969.50	0.15
COOP-GRUPPE 0.875 15-24 31/07A	31.07.24	250'000	0	0	250'000	99.99	249'971.25	0.13
COOP-GRUPPE GENOSSEN 0.50 17-27 29/09A	29.09.27	250'000	0	0	250'000	97.45	243'620.00	0.13
CORNER BANCA 3.0 23-25 14/07A	14.07.25	250'000	0	0	250'000	101.32	253'300.00	0.14
EMIS FUER GEM W 0.7500 18-32 29/11A	29.11.32	0	300'000	0	300'000	98.38	295'129.50	0.16
EMMI FINANZ AG 2.0 23-28 22/09A	22.09.28	250'000	0	0	250'000	102.88	257'205.00	0.14
GIVAUDAN AG 1.125 -22 15/06A	15.06.26	200'000	0	0	200'000	99.96	199'913.00	0.11
KRAFTWERKE LINTH L 2.375 13-26 10/12A	10.12.26	300'000	0	0	300'000	102.36	307'072.50	0.16
KRAFTWERKE LINTHLIMM 2.25 23-25 05/12A	05.12.25	200'000	0	0	200'000	101.17	202'346.00	0.11
KRAFTWERKE OBERHAS 0.125 21-31 21/02A	21.02.31	100'000	0	0	100'000	92.33	92'331.50	0.05
LAFARGE HOLC HELV FIN 0.125 21-27 26/08A	26.08.27	250'000	0	0	250'000	96.34	240'858.75	0.13
LUZE KA 2.05 22-47 16/09A	16.09.47	200'000	0	0	200'000	117.46	234'924.00	0.13
LUZERNER KANTONALBA 1.6 24-44 08/03A	08.03.44	0	250'000	0	250'000	106.53	266'315.00	0.14
LUZERNER KANTONALBAN 1.9 23-31 19/06A	19.06.31	0	150'000	0	150'000	104.75	157'122.75	0.08
LUZERNER KANTONALBAN 2.0 23-38 19/11A	19.11.38	0	250'000	0	250'000	109.84	274'590.00	0.15
NANT DE DRANCE 2.3500 23-31 24/07A	24.07.31	0	100'000	0	100'000	105.82	105'819.00	0.06
NESTLE 1.625 22-26 15/07A	15.07.26	250'000	0	0	250'000	100.96	252'401.25	0.13
NESTLE 1.625 23-27 20/11A	20.11.27	250'000	0	0	250'000	101.62	254'056.86	0.14
NESTLE 2.125 22-30 15/07A	15.07.30	250'000	0	0	250'000	105.40	263'506.25	0.14
NESTLE 2.5 22-34 14/07A	14.07.34	250'000	0	0	250'000	110.78	276'948.75	0.15
NIDWALDNER KANTONA 0.25 16-26 27/05A	27.05.26	250'000	0	0	250'000	98.14	245'348.75	0.13
NOVARTIS AG 0.25 15-25 13/05A	13.05.25	350'000	0	350'000	0	0.00	0.00	0.00
NOVARTIS AG 1.6 24-27 18/06A	18.06.27	0	250'000	0	250'000	101.43	253'567.50	0.14
NOVARTIS AG 1.85 24-40 18/06A	18.06.40	0	250'000	0	250'000	105.55	263'880.00	0.14
PFANDBRIEF 0.75 18-33 21/06A	21.06.33	200'000	0	0	200'000	96.29	192'588.00	0.10
PFANDBRIEF SCH KANTBK 0.625 17-35 25/01A	25.01.35	250'000	0	0	250'000	94.16	235'406.25	0.13
PFANDBRIEF SCHW 0.0000 20-31 02/04A	02.04.31	200'000	0	0	200'000	92.71	185'416.00	0.10
PFANDBRIEF SCHW 0.1000 21-31 03/10A	03.10.31	500'000	0	0	500'000	92.71	463'570.00	0.25
PFANDBRIEF SCHW 0.1250 20-32 23/04A	23.04.32	250'000	0	0	250'000	92.36	230'892.50	0.12
PFANDBRIEF SCHW 0.1250 21-31 19/12A	19.12.31	250'000	0	0	250'000	92.80	232'002.50	0.12
PFANDBRIEF SCHW 0.2500 20-41 15/03A	15.03.41	250'000	0	0	250'000	85.64	214'087.50	0.11
PFANDBRIEF SCHW 0.375 17-28 24/07A	24.07.28	250'000	0	0	250'000	97.19	242'978.75	0.13
PFANDBRIEF SCHW 0.5000 15-30 30/04A	30.04.30	250'000	0	0	250'000	96.60	241'501.25	0.13
PFANDBRIEF SCHW 0.625 14-25 19/03A	19.03.25	300'000	0	300'000	0	0.00	0.00	0.00
PFANDBRIEF SCHW 1.5000 22-29 17/12A	17.12.29	0	200'000	0	200'000	102.13	204'260.00	0.11

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.1250 20-30 02/08A	02.08.30	250'000	0	0	250'000	94.20	235'487.50	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.125 16-28 06/09A	06.09.28	250'000	0	0	250'000	96.08	240'197.50	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.125 16-32 23/09A	23.09.32	0	250'000	0	250'000	91.80	229'487.50	0.12
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.125 17-25 06/05A	06.05.25	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-36 14/10A	14.10.36	250'000	0	0	250'000	88.85	222'115.00	0.12
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-38 04/08A	04.08.38	500'000	0	0	500'000	87.50	437'505.00	0.23
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17-26 20/10A	20.10.26	250'000	0	0	250'000	98.08	245'195.00	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17-27 18/01A	18.01.27	500'000	0	0	500'000	97.91	489'527.50	0.26
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 16-32 26/01A	26.01.32	350'000	0	0	350'000	94.37	330'279.25	0.18
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 16-39 08/07	08.07.39	250'000	0	0	250'000	88.47	221'165.00	0.12
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.50 16-35 05/10A	05.10.35	250'000	0	0	250'000	92.39	230'985.00	0.12
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.625 15-34 25/01A	25.01.34	250'000	0	0	250'000	94.73	236'830.00	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.75 15-34 28/11A	28.11.34	250'000	0	0	250'000	95.38	238'458.75	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.00 15-45 25/01A	25.01.45	0	250'000	0	250'000	96.94	242'360.00	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.375 12-27 13/08A	13.08.27	500'000	0	0	500'000	100.89	504'460.00	0.27
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 12-27 27/04A	27.04.27	300'000	0	0	300'000	101.18	303'526.50	0.16
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 14-40 05/12A	05.12.40	250'000	0	0	250'000	104.54	261'360.00	0.14
PFANDBRIEF SCHWEIZ H 2.0 23-40 04/10A	04.10.40	0	250'000	0	250'000	111.93	279'813.75	0.15
PFANDBRIEF SCHWEIZ H 2.25 22-52 05/07A	05.07.52	0	250'000	0	250'000	127.17	317'931.25	0.17
PFANDBRIEF SCHWEIZ HYP 0.00 2°-29 26/10A	26.10.29	200'000	0	0	200'000	94.33	188'666.00	0.10
PFANDBRIEF SCHWIEZ 1.50 12-33 02/08A	08.08.33	200'000	0	0	200'000	102.65	205'301.00	0.11
PFANDBRIEF SCHW KA 0.125 16-31 02/09A	02.09.31	300'000	0	0	300'000	93.05	279'141.00	0.15
PFANDBRIEF SCHW KA 0.25 16-28 11/02A	11.02.28	500'000	0	0	500'000	97.03	485'135.00	0.26
PFANDBRIEF SCHW KA 0.25 17-25 01/12A	01.12.25	200'000	0	100'000	100'000	98.76	98'759.50	0.05
PFANDBRIEF SCHW KA 0.30 16-31 06/06A	06.06.31	500'000	0	0	500'000	94.49	472'440.00	0.25
PFANDBRIEF SCHW KA 0.375 16-28 24/10A	24.10.28	250'000	0	0	250'000	97.00	242'493.75	0.13
PFANDBRIEF SCHW KA 0.50 15-30 20/09A	20.09.30	0	250'000	0	250'000	96.30	240'757.50	0.13
PFANDBRIEF SCHW KA 0.50 16-34 30/03A	30.03.34	500'000	0	0	500'000	93.48	467'385.00	0.25
PFANDBRIEF SCHW KA 0.5 17-32 20/02A	20.02.32	200'000	0	0	200'000	95.31	190'611.00	0.10
PFANDBRIEF SCHW KA 0.60 16-35 11/12A	11.12.35	250'000	0	0	250'000	93.37	233'430.00	0.12
PFANDBRIEF SCHW KA 0.625 15-29 16/07A	16.07.29	250'000	0	0	250'000	97.69	244'233.75	0.13
PFANDBRIEF SCHW KA 0.625 15-30 12/02A	12.02.30	200'000	0	0	200'000	97.40	194'798.00	0.10
PFANDBRIEF SCHW KA 1.50 14-29 05/02A	05.02.29	250'000	0	0	250'000	101.81	254'520.00	0.14
PFANDBRIEF SCHW KA 1.75 11-26 02/09A	02.09.26	500'000	0	0	500'000	101.38	506'877.50	0.27

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
PFANDBRIEFZENTRALE 0.50 18-28 19/05A	19.05.28	250'000	0	0	250'000	97.76	244'407.50	0.13
PFANDBRIEFZENTRALE 0.75 18-32 01/10A	01.10.32	200'000	0	0	200'000	96.71	193'426.00	0.10
PFANDBRIEFZENTRALE 1.7 22-32 27/07A	27.07.32	200'000	0	0	200'000	104.14	208'275.00	0.11
PFANDBRIEFZENTRALE S 1.4 24-38 15/03A	15.03.38	0	200'000	0	200'000	102.42	204'840.00	0.11
PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.0 21-28 13/03A	13.03.28	50'000	0	50'000	0	0.00	0.00	0.00
PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3 19-29 05/03A	09.04.29	250'000	0	0	250'000	96.32	240'802.50	0.13
PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.5 19-34 15.05A	15.05.34	400'000	0	0	400'000	93.39	373'544.00	0.20
PFANDBRIEFZENTRALE S K 0.0 21-31 25/07A	25.07.31	300'000	0	0	300'000	92.31	276'919.50	0.15
PFANDBR SCHWEIZ HYPO 1.625 13-30 03/07A	03.07.30	200'000	0	0	200'000	103.00	206'001.00	0.11
PFANDBR SCHWEIZ HYPO 2.25 10-32 13/08A	13.08.32	250'000	0	0	250'000	108.40	271'008.75	0.14
PFBRF SCHWZ HYPO 0.50 15-29 15/06A	15.06.29	250'000	0	0	250'000	97.15	242'876.25	0.13
PFBRF SCHWZ HYPO 0.75 17-38 18/10A	18.10.38	250'000	0	0	250'000	94.00	234'988.75	0.13
PFBRF SCHWZ KANTBK 0.25 17-27 06/12A	06.12.27	250'000	0	0	250'000	97.22	243'040.00	0.13
PFBRF SCHWZ KANTBK 0.65 18-33 15/02A	15.02.33	250'000	0	0	250'000	95.67	239'168.75	0.13
PSP SWISS PROPERTY 1.70 24-30 06/02A	06.02.30	0	250'000	0	250'000	101.39	253'463.75	0.14
ROCHE KAPITALMA 0.5000 22-27 25/02A	25.02.27	300'000	0	0	300'000	98.34	295'032.00	0.16
ROCHE KAPITALMA 0.7500 22-31 25/02A	25.02.31	250'000	0	0	250'000	97.31	243'270.00	0.13
ROCHE KAPITALMARKT 0.45 17-29 23/03A	23.03.29	250'000	0	0	250'000	97.00	242'495.00	0.13
ROCHE KAPITALMARKT A 1.6 23-28 15/09A	15.09.28	100'000	0	0	100'000	101.99	101'988.00	0.05
ROCHE KAPITALMARKT A 1.75 23-33 15/09A	15.09.33	250'000	0	0	250'000	104.25	260'615.00	0.14
ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	23.09.32	250'000	0	0	250'000	106.23	265'576.25	0.14
ROMANDE ENERGIE 2.625 22-37 15/07A	15.07.37	100'000	0	0	100'000	113.97	113'972.00	0.06
SANDOZ GROUP 2.6 23-31 17/11A	17.11.31	250'000	0	0	250'000	105.98	264'955.00	0.14
SIKA SA 0.625 18-24 12/07A	12.07.24	250'000	0	0	250'000	100.01	250'032.50	0.13
SIX GROUP AG 0.2000 21-29 28/09A	28.09.29	300'000	0	0	300'000	94.29	282'856.50	0.15
ST COOP CENT D'EMI 1.70 23-41 29/04A	29.04.41	250'000	0	0	250'000	110.78	276'960.00	0.15
SWISS PRIME SIT 0.65 20-29 18/12A	18.12.29	250'000	0	0	250'000	95.19	237'962.50	0.13
SWITZERLAND 0.00 16-29 22/06U	22.06.29	650'000	0	150'000	500'000	97.03	485'125.00	0.26
SWITZERLAND 0.25 21-35 23/06A	23.06.35	300'000	0	0	300'000	97.01	291'028.50	0.16
SWITZERLAND 0.5000 18-32 27/06A	27.06.32	500'000	0	0	500'000	99.63	498'142.50	0.27
SWITZERLAND 0.50 15-30 27/05A	27.05.30	500'000	0	0	500'000	99.63	498'172.50	0.27
SWITZERLAND 0.5 17-45 28/06A	28.06.45	500'000	0	0	500'000	99.08	495'422.50	0.26
SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	26.06.34	250'000	0	0	250'000	94.85	237'136.25	0.13
SWITZERLAND 0 19-39 24/07U	24.07.39	250'000	0	0	250'000	92.31	230'786.25	0.12
SWITZERLAND 1.25 12-37 27/06A	27.06.37	500'000	0	0	500'000	109.09	545'430.00	0.29
SWITZERLAND 1.25 14-26 28/05A	28.05.26	300'000	0	0	300'000	100.95	302'856.00	0.16
SWITZERLAND 1.50 12-42 30/04A	30.04.42	650'000	0	0	650'000	116.17	755'105.00	0.40
SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	24.07.25	500'000	0	100'000	400'000	100.65	402'590.00	0.21
SWITZERLAND 1.5 22-38 26/10A	26.10.38	0	250'000	0	250'000	113.31	283'277.50	0.15
SWITZERLAND 2.25 11-31 22/06A	22.06.31	500'000	0	0	500'000	111.65	558'247.50	0.30
SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	08.03.36	500'000	0	0	500'000	122.43	612'157.50	0.33

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
SWITZERLAND 3.25 07-27 27/06A	27.06.27	500'000	0	0	500'000	107.62	538'112.50	0.29
SWITZERLAND 3.50 03-33 08/04A	08.04.33	500'000	0	0	500'000	125.35	626'747.50	0.33
SWITZERLAND 4.00 98-28 08/04A	08.04.28	1'000'000	0	250'000	750'000	112.47	843'510.00	0.45
SWITZERLAND 4.00 99-49 06/01A	06.01.49	250'000	0	0	250'000	179.33	448'328.75	0.24
SWITZERLAND GOVERNME 0.875 24-47 22/05A	22.05.47	0	250'000	0	250'000	106.76	266'900.00	0.14
UBS GROUP SA 0.435 21-28 09/11A	09.11.28	200'000	0	200'000	0	0.00	0.00	0.00
ZUERCHER KANTONALB 0.25 17-26 27/01A	27.01.26	300'000	0	0	300'000	98.52	295'572.00	0.16
ZUERCHER KANTONAL BANK 0.3 18-28 25/01A	25.01.28	250'000	0	0	250'000	97.12	242'791.25	0.13
<i>Schweiz</i>							43'091'601.86	22.97
DBS BANK 1.515 22-25 12/12A	12.12.25	200'000	0	0	200'000	100.52	201'032.00	0.11
<i>Singapur</i>							201'032.00	0.11
BBVA 2.77 22-28 28/11A	28.11.28	0	200'000	0	200'000	105.17	210'347.00	0.11
SANTANDER CONSUMER F 2.7325 23-25 04/07A	04.07.25	150'000	0	0	150'000	101.30	151'956.00	0.08
<i>Spanien</i>							362'303.00	0.19
HYUNDAI CAPITAL SERV 0.26 20-25 11/02A	11.02.25	150'000	0	150'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Südkorea</i>							0.00	0.00
APPLE INC 0.375 15-24 25/11A	25.11.24	250'000	0	250'000	0	0.00	0.00	0.00
EQUINIX EUROPE 1 2.875 23-28 12/09A	12.09.28	250'000	0	0	250'000	104.32	260'796.25	0.14
NESTLE HOLDINGS INC 0.25 17-27 04/10A	04.10.27	250'000	0	0	250'000	97.48	243'705.00	0.13
THERMO FISHER SCIENT 1.8401 24-32 08/03A	08.03.32	0	250'000	0	250'000	102.86	257'141.25	0.14
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							761'642.50	0.41
Schweizer Franken							55'724'306.61	29.71
Die an einer Börse gehandelt Effekten							55'724'306.61	29.71
BFCM 0.366 18-24 10/10A	10.10.24	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Frankreich</i>							0.00	0.00
Schweizer Franken							0.00	0.00
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden							0.00	0.00
Anleihen							55'724'306.61	29.71
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere							55'724'306.61	29.71

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anteile in Investmentfonds							
ISHARES CORE MSCI EM IMI UCITS ETF	50'300	0	22'400	27'900	34.31	860'162.02	0.46
ISHARES III ISHARES CORE MSCI WLD UCITS	88'300	0	34'800	53'500	101.98	4'902'767.24	2.61
ISHARES JP MORGAN EM LOC GOVT BD UCITS D	190'900	35'726	0	226'626	43.32	8'820'706.99	4.70
SPDR MSCI WORLD SMALL CAP UCITS ETF	60'500	19'400	0	79'900	100.84	7'239'939.88	3.86
SPDR MSCI WORLD UCITS ETF	0	22'000	0	22'000	37.27	736'779.30	0.39
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	5'000	0	5'000	0	0.00	0.00	0.00
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	84'000	0	0	84'000	11.80	890'292.21	0.47
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	14'290	0	0	14'290	56.56	726'268.11	0.39
<i>Irland</i>						24'176'915.75	12.89
ISHARES RUSSEL 2000 ETF FUND	6'350	0	6'350	0	0.00	0.00	0.00
SPDR S&P500 ETF TRUST	1'800	0	1'800	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						0.00	0.00
Dollar Us						24'176'915.75	12.89
DB X-TRACKERS MSCI EUE SML CAP TRN -1C-	15'200	0	15'200	0	0.00	0.00	0.00
<i>Luxemburg</i>						0.00	0.00
Euro						0.00	0.00
ISHARES COR GLO AGGRE BOND-H ACC CHF ETF	1'168'000	138'000	0	1'306'000	4.53	5'911'609.00	3.15
SPDR BLOOMBERG BARCLAYS GBL AGG BDHDG	210'000	0	0	210'000	27.20	5'712'840.00	3.05
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	91'560	0	0	91'560	100.42	9'194'455.20	4.90
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1D	5'000	0	0	5'000	85.18	425'900.00	0.23
<i>Irland</i>						21'244'804.20	11.33
DBXT2 GLOB AGG-4C- CAP ETF	333'000	110'557	0	443'557	15.27	6'774'224.28	3.61
UBS-BLOOMB BAR MSCI EURO AREA LIQ-A H C	622'000	72'000	0	694'000	12.83	8'902'285.00	4.75
<i>Luxemburg</i>						15'676'509.28	8.36
ISHS CORE SPIE ETF -A- SWISSINVEST RE INV	6'200	6'700	2'600	10'300	144.28	1'486'084.00	0.79
UBS SXI RE FD - ANTEILE -(CHF) A- DIS-	4'920	0	0	4'920	192.50	947'100.00	0.50
ZKB GOLD ETF -A CHF-	0	136'000	0	136'000	9.08	1'235'424.00	0.66
	1'600	0	0	1'600	623.90	998'240.00	0.53
<i>Schweiz</i>						4'666'848.00	2.49
Schweizer Franken						41'588'161.48	22.17
Die an einer Börse gehandelt Effekten						65'765'077.23	35.06
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	17'951	0	0	17'951	120.87	1'949'694.15	1.04

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
VANGUARD GLB SMALL CAP INX USD C	5'500	0	0	5'500	349.37	1'726'646.84	0.92
<i>Irland</i>						<i>3'676'340.99</i>	<i>1.96</i>
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	137	0	0	137	15'362.49	1'891'200.28	1.01
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	800	0	0	800	1'405.62	1'010'446.35	0.54
MS INV F GLOBAL CONVERT BOND Z ACC	39'100	0	0	39'100	49.63	1'743'718.50	0.93
<i>Luxemburg</i>						<i>4'645'365.13</i>	<i>2.48</i>
Dollar Us						8'321'706.12	4.44
UBS EUR EQUIT DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	4'000	0	4'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Irland</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
Euro						0.00	0.00
CSIMF SWISS REAL ESTATE SECURITIES EB	1'960	0	0	1'960	1'899.87	3'723'745.20	1.99
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	42'385	0	23'206	19'179	108.00	2'071'332.00	1.10
<i>Schweiz</i>						<i>5'795'077.20</i>	<i>3.09</i>
Schweizer Franken						5'795'077.20	3.09
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden						14'116'783.32	7.53
Anteile in Investmentfonds						79'881'860.55	42.58

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung		Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Strukturierte Produkte									
SG ISSUER CV	0.00 23-24 11/12A	11.12.24	10'800	0	0	10'800	432.10	4'193'371.75	2.24
<i>Luxemburg</i>								4'193'371.75	2.24
BNP PARIBAS ISSUANCE BV ZCP 23-24 28/02U		28.02.24	22'500	0	22'500	0	0.00	0.00	0.00
<i>Niederlande</i>								0.00	0.00
Dollar Us								4'193'371.75	2.24
Die an einer Börse gehandelt Effekten								4'193'371.75	2.24
BARCLAYS BANK PLC	ZCP 24-25	28.02.25	0	22'500	0	22'500	436.29	8'820'904.50	4.70
28/02U									
UBS LONDON PERLES 2013	13-XX	31.12.99	19'190	0	0	19'190	431.85	7'446'689.44	3.97
31/12U									
<i>Großbritannien</i>								16'267'593.94	8.67
Dollar Us								16'267'593.94	8.67
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden								16'267'593.94	8.67
Strukturierte Produkte								20'460'965.69	10.91

Inventar des Vermögens

	Verfall	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verkehrswert CHF	in %
Derivative Finanzinstrumente							
Devisentermingeschäfte ¹							
	15.11.24	3'996'193.50	CHF	4'500'000.00	USD	18'250.49	0.01
	12.08.24	4'453'862.40	CHF	5'200'000.00	USD	-195'627.16	-0.10
	15.05.24	3'988'840.50	CHF	4'500'000.00	USD	0.00	0.00
	12.02.24	4'464'917.60	CHF	5'200'000.00	USD	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte						-177'376.67	-0.09
Derivative Finanzinstrumente						-177'376.67	-0.09

¹ Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zuercher Kantonalbank

Titelbezeichnung	Verkehrswert CHF	in %
Bankguthaben		
Sichtguthaben	1'990'100.10	1.06
Collateral	100'000.00	0.05
Bankguthaben	2'090'100.10	1.11

Devisenkurs

1 EUR	=	CHF	0.96305
1 USD	=	CHF	0.89858

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen	
Devisentermingeschäfte	8'627'432.57
Total in CHF	8'627'432.57
Total in % des Nettofondsvermögens	4.66

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹		Anzahl Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	Thesaurierung des Nettoertrags je Anteil
31.12.22	Klasse A1	CHF	99.95	626'857.992	62'654'703.71	0.7961
31.12.23	Klasse A1	CHF	104.82	725'022.319	75'994'451.23	0.9758
28.06.24	Klasse A1	CHF	110.78	818'471.529	90'672'492.25	0.00
31.12.22	Klasse A2	CHF	98.63	807'232.588	79'620'119.27	0.7908
31.12.23	Klasse A2	CHF	103.12	707'680.572	72'978'597.55	0.9601
28.06.24	Klasse A2	CHF	108.83	612'650.638	66'675'856.63	0.00
31.12.22	Klasse H1	CHF	104.26	10.000	1'042.55	0.8350
31.12.23	Klasse H1	CHF	109.85	10.000	1'098.46	1.023
28.06.24	Klasse H1	CHF	116.38	10.000	1'163.77	0.00
31.12.22	Klasse R1	CHF	100.02	182'786.216	18'282'774.04	0.7958
31.12.23	Klasse R1	CHF	104.89	217'189.216	22'781'597.70	0.9766
28.06.24	Klasse R1	CHF	110.86	245'411.216	27'206'907.88	0.00
31.12.22	Klasse E	CHF	87.50	2'163.222	189'273.01	0.6941
31.12.23	Klasse E	CHF	92.08	3'530.407	325'074.79	0.8573
28.06.24	Klasse E	CHF	97.49	4'490.242	437'744.34	0.00

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Vermögensrechnung

	28.06.24	31.12.23
(Börsenwert)	CHF	CHF
Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	35'886'903.00	32'073'678.80
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	19'060'954.74	15'776'126.12
Investmentfondsanteile	57'515'403.96	49'647'796.23
Strukturierte Produkte	12'381'661.63	14'657'378.61
Derivative Finanzinstrumente	-85'529.15	249'217.13
Bankguthaben		
Sichtguthaben	1'307'143.35	1'130'843.69
Sonstige Vermögenswerte	889'361.30	454'911.35
Gesamtfondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	126'955'898.83	113'989'951.93
Andere Verbindlichkeiten	-720'414.86	-269'146.92
Ausstehende Rückkäufe	-24'972.00	0.00
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	126'210'511.97	113'720'805.01

Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode	113'720'805.01	98'440'183.04
35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	-321'597.92	-254'603.14
Saldo aus dem Anteilverkehr	563'963.30	8'746'717.74
Gesamterfolg	12'247'341.58	6'788'507.37
Nettofondsvermögen bei Abschluss der Rechnungsperiode	126'210'511.97	113'720'805.01

Entwicklung der Anzahl der Anteile

Klasse A1

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		688'420.301	625'106.263
Ausgegebene Anteile		0.000	63'314.038
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		688'420.301	688'420.301
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	125.18	113.33

Klasse A2

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		233'452.180	233'452.180
Ausgegebene Anteile		0.000	0.000
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		233'452.180	233'452.180
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	123.49	111.86

Klasse R1

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		83'298.000	68'072.000
Ausgegebene Anteile		10'690.000	20'896.000
Zurückgenommene Anteile		7'648.000	5'670.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		86'340.000	83'298.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	125.18	113.33

Klasse E

		01.01.24	01.01.23
		28.06.24	31.12.23
Stand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'563.662	774.117
Ausgegebene Anteile		2'280.896	789.545
Zurückgenommene Anteile		0.000	0.000
Stand bei Abschluss der Rechnungsperiode		3'844.558	1'563.662
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹	CHF	102.37	92.62

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.

Erfolgsrechnung	01.01.24	01.01.23
	28.06.24	31.12.23
	CHF	CHF
Erträge		
Erträge der Effekten		
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere	812'498.33	870'890.10
Erträge der Obligationen	104'680.08	140'792.63
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen ¹	193'637.62	856'677.01
Ertrag der Bankguthaben		
Sichtguthaben	8'572.33	20'566.25
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3'182.67	25'201.31
Total Erträge	1'122'571.03	1'914'127.30
Aufwendungen		
Reglementarische Vergütungen :		
an die Fondsleitung	-17'910.44	-31'602.45
an die Depotbank	-18'045.44	-31'752.45
an die Verwaltung	-517'871.05	-919'206.45
Prüfaufwand	-5'892.20	-11'847.00
Passivzinsen	0.00	-700.94
Sonstige Aufwendungen	-1'064.09	-2'790.71
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-2'239.73	-2'028.89
Total Aufwendungen	-563'022.95	-999'928.89
Nettoertrag	559'548.08	914'198.41
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	1'428'732.79	-827'936.30
Realisierter Erfolg	1'988'280.87	86'262.11
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	10'259'060.71	6'702'245.26
Gesamterfolg	12'247'341.58	6'788'507.37
<u>Synthetische TER in % : Klasse A1</u>	1.02	1.04
<u>Synthetische TER in % : Klasse A2</u>	1.32	1.34
<u>Synthetische TER in % : Klasse R1</u>	1.02	1.04
<u>Synthetische TER in % : Klasse E</u>	0.62	0.64

¹ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 20.11.2017, Kap. 2.8.

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
AMS-OSRAM AG	0	90'000	90'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Österreich</i>						<i>0.00</i>	<i>0.00</i>
ABB LTD	34'500	2'000	0	36'500	49.92	1'822'080.00	1.44
ACCELLERON INDUSTRIES AG	7'000	0	0	7'000	35.20	246'400.00	0.19
ADECCO REG.SHS	4'900	0	4'900	0	0.00	0.00	0.00
ALCON - REG SHS	12'200	700	0	12'900	80.22	1'034'838.00	0.82
ARYZTA	110'000	110'000	110'000	110'000	1.60	176'000.00	0.14
BACHEM HOLDING LTD SHARES	0	3'000	0	3'000	82.45	247'350.00	0.19
BALOISE HOLDING - REG SHS	1'400	0	0	1'400	158.20	221'480.00	0.17
BARRY CALLEBAUT LTD - NAMEN-AKT	150	0	150	0	0.00	0.00	0.00
BELIMO HOLDING LTD	0	440	0	440	450.60	198'264.00	0.16
BKW AG	1'500	0	0	1'500	143.30	214'950.00	0.17
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING	0	280	0	280	590.00	165'200.00	0.13
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	45	5	0	50	10'490.00	524'500.00	0.41
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	11'500	700	0	12'200	140.25	1'711'050.00	1.35
CLARIANT NAMEN AKT	11'700	0	11'700	0	0.00	0.00	0.00
DKSH HOLDING SA	0	2'800	0	2'800	60.70	169'960.00	0.13
DOTTIKON ES HLDG - REGISTERED SHS	0	750	0	750	253.00	189'750.00	0.15
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	240	0	0	240	736.50	176'760.00	0.14
FLUGHAFEN ZUERICH AG	900	0	900	0	0.00	0.00	0.00
GALDERMA GROUP AG	0	3'200	0	3'200	73.96	236'672.00	0.19
GALENICA SA	0	2'200	2'200	0	0.00	0.00	0.00
GEBERIT AG	700	0	0	700	530.80	371'560.00	0.29
GEORG FISCHER LTD	3'000	0	0	3'000	60.25	180'750.00	0.14
GIVAUDAN SA - REG SHS	190	10	0	200	4'260.00	852'000.00	0.67
HOLCIM LTD	14'500	900	1'300	14'100	79.62	1'122'642.00	0.88
JULIUS BAER GROUP - REG SHS	5'500	0	0	5'500	50.20	276'100.00	0.22
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	1'600	600	400	1'800	258.40	465'120.00	0.37
LOGITECH INTERNATIONAL SA - NAMEN-AKT	4'000	500	0	4'500	86.92	391'140.00	0.31
LONZA GROUP	1'800	100	0	1'900	490.40	931'760.00	0.73
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	57'500	3'200	1'300	59'400	91.72	5'448'168.00	4.29
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	46'000	2'400	1'500	46'900	96.17	4'510'373.00	3.55
PARTNERS GROUP HOLDING AG - NAMNE-AKT	550	50	0	600	1'154.00	692'400.00	0.55
ROCHE HOLDING LTD - DIVIDEND RIGHT CERT	15'900	1'300	0	17'200	249.50	4'291'400.00	3.38
SANDOZ GROUP AG	8'880	1'120	0	10'000	32.54	325'400.00	0.26
SCHINDLER HOLDING SA	1'500	0	0	1'500	225.80	338'700.00	0.27
SGS LTD	2'500	2'000	0	4'500	80.00	360'000.00	0.28
SIEGFRIED HOLDING	240	240	240	240	933.00	223'920.00	0.18
SIG GROUP PREFERENTIAL SHARE	12'000	0	0	12'000	16.45	197'400.00	0.16
SIKA - REGISTERED SHS	3'100	500	0	3'600	257.20	925'920.00	0.73
SONOVA HOLDING LTD - NAMEN-AKT	850	150	0	1'000	277.60	277'600.00	0.22
STRAUMANN HOLDING LTD - REG SHS	3'000	700	400	3'300	111.30	367'290.00	0.29
SWISSCOM SHS NOM	550	100	0	650	505.50	328'575.00	0.26
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	950	0	200	750	660.60	495'450.00	0.39
SWISSQUOTE GROUP HOLDING	1'000	0	1'000	0	0.00	0.00	0.00
SWISS RE - REG SHS	6'000	700	0	6'700	111.50	747'050.00	0.59
TECAN GROUP NAM.AKT	0	570	0	570	300.80	171'456.00	0.14
TEMENOS AG NAM.AKT	4'300	0	4'300	0	0.00	0.00	0.00

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere							
THE SWATCH GROUP	1'300	0	0	1'300	184.05	239'265.00	0.19
UBS GROUP NAMEN-AKT	71'000	4'000	0	75'000	26.45	1'983'750.00	1.56
VAT GROUP SA	800	0	0	800	509.40	407'520.00	0.32
ZÜRICH INSURANCE GROUP - REG SHS	3'500	200	300	3'400	479.10	1'628'940.00	1.28
<i>Schweiz</i>						35'886'903.00	28.27
Schweizer Franken						35'886'903.00	28.27
Die an einer Börse gehandelt Effekten						35'886'903.00	28.27
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere						35'886'903.00	28.27
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte						35'886'903.00	28.27

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere								
Anleihen								
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30 17-25 31/10A	03.02.31	200'000	0	0	200'000	95.50	190'994.00	0.15
NATIONAL AUSTRALIA BK 0.30 17-25 31/10A	31.10.25	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
WESTPAC BANKING 1.8025 22-29 21/09A	21.09.29	150'000	0	0	150'000	103.10	154'645.50	0.12
<i>Australien</i>							345'639.50	0.27
SCOTIABANK CHILE 0.385 21-26 22/07A	22.07.26	200'000	0	0	200'000	97.14	194'282.00	0.15
<i>Chile</i>							194'282.00	0.15
MUENCHENER HYPO 0.25 20-28 18/09A	18.09.28	0	100'000	0	100'000	95.16	95'163.00	0.07
MUENCHENER HYPO 0.5000 18-28 14/06A	14.06.28	100'000	0	0	100'000	97.38	97'384.50	0.08
MUENCHENER HYPOTHEKE 0.1 20-25 17/12A	17.12.25	200'000	0	0	200'000	97.96	195'913.00	0.15
MUENCHENER HYPOTHEKE 0.25 21- 27 30/03A	30.03.27	200'000	0	0	200'000	96.40	192'807.00	0.15
<i>Deutschland</i>							581'267.50	0.46
ENGIE 2.34 23-27 04/01A	04.01.27	200'000	0	0	200'000	102.01	204'028.00	0.16
<i>Frankreich</i>							204'028.00	0.16
CABEI 0.405 20-25 25/06A	25.06.25	200'000	0	0	200'000	99.05	198'094.00	0.16
<i>Honduras</i>							198'094.00	0.16
BANK OF NOVA SC 0.2000 18-25 19/11A	19.11.25	200'000	0	100'000	100'000	98.64	98'636.50	0.08
BANK OF NOVA SCOTIA 0.7325 22- 2925/04A	25.04.29	100'000	100'000	0	200'000	97.78	195'555.00	0.15
CAN IMP BK 1.91 23-28 14/07A	14.07.28	100'000	0	0	100'000	102.98	102'977.50	0.08
CIBC 0.18 21-29 20/04A	20.04.29	150'000	0	0	150'000	94.16	141'234.75	0.11
PROVINCE OF SASKATCH 1.315 24-34 02/05A	02.05.34	0	100'000	0	100'000	101.69	101'686.50	0.08
PROV OF NW BRUNSWICK 0.125 19-32 06/12A	06.12.32	100'000	0	0	100'000	91.60	91'596.50	0.07
QUEBEC MONTREAL 2.04 23-33 09/05A	09.05.33	100'000	0	0	100'000	107.46	107'463.00	0.08
ROYAL BANK OF CANADA 0.20 21-31 22/09A	22.09.31	100'000	0	0	100'000	91.10	91'095.00	0.07
<i>Kanada</i>							930'244.75	0.73
EUROPEAN INVEST 1.7500 13-33 28/06A	28.06.33	100'000	0	0	100'000	107.19	107'188.00	0.08
<i>Luxemburg</i>							107'188.00	0.08
AUCKLAND COUNCIL 1.5 14-25 28/11A	28.11.25	100'000	0	0	100'000	100.51	100'505.00	0.08
AUCKLAND COUNCIL 1.56 23-29 30/11A	30.11.29	100'000	0	0	100'000	102.47	102'470.00	0.08
<i>Neuseeland</i>							202'975.00	0.16

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
ABN AMRO BK 2.3 23-25 26/06A	26.06.25	200'000	0	0	200'000	100.89	201'783.00	0.16
MERCEDESSENZ INTL FI 2.1075 23-29 12/10A	12.10.29	0	100'000	0	100'000	103.96	103'957.50	0.08
TOYOTA MOTOR FINANCE 2.13 23-27 15/06A	15.06.27	100'000	0	0	100'000	102.25	102'248.50	0.08
<i>Niederlande</i>							407'989.00	0.32
BAWAG BK 1.96 23-31 26/05A	26.05.31	0	100'000	0	100'000	104.27	104'268.50	0.08
HYPO NOE GRUPPE 2.375 24-29 26/01A	26.01.29	0	200'000	0	200'000	102.39	204'786.00	0.16
OESTER.KONTROLLBK 2.875 05-30 25/02A	25.02.30	100'000	0	0	100'000	110.44	110'440.50	0.09
<i>Österreich</i>							419'495.00	0.33
ASIA DEV BK 0.875 22-29 13/09U	13.09.29	100'000	0	0	100'000	99.96	99'961.00	0.08
<i>Philippinen</i>							99'961.00	0.08
AKADEMISKA HUS 0.30 17-29 08/10A	08.10.29	100'000	0	0	100'000	95.82	95'823.00	0.08
<i>Schweden</i>							95'823.00	0.08
AARGAUISCHE KANTON 0.875 15-30 23/01A	23.01.30	100'000	0	0	100'000	98.48	98'484.50	0.08
ADECCO 2.3775 22-27 17/11A	17.11.27	100'000	0	0	100'000	102.76	102'762.00	0.08
ADECCO GROUP SA 0.875 18-26 18/09A	18.09.26	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
BALOISE 2.2 23-32 30/01A	30.01.32	150'000	0	0	150'000	105.16	157'734.00	0.12
BALOISE HOLDING 0.25 20-26 16/12A	16.12.26	100'000	0	0	100'000	97.55	97'549.00	0.08
BANQUE DES LETTRES 0.125 19-30 10/12A	10.12.30	150'000	0	0	150'000	93.84	140'752.50	0.11
BASELLANDSCHAFT 0.0100 21-33 28/01A	28.01.33	100'000	0	0	100'000	90.21	90'213.00	0.07
BASELLANDSCHAFT 0.1250 21-31 06/10A	06.10.31	100'000	0	0	100'000	92.46	92'458.50	0.07
BASELLANDSCHAFT 1.6000 22-32 13/05A	13.05.32	100'000	0	0	100'000	102.85	102'847.50	0.08
BASELLANDSCHAFT KA 0.25 15-25 13/05A	13.05.25	100'000	0	100'000	0	0.00	0.00	0.00
BQUE LETTER 1.125 18-47 19/10A	18.10.47	0	150'000	0	150'000	99.32	148'973.25	0.12
BQUE LETTRE 2.125 13-33 28/11A	28.11.33	0	100'000	0	100'000	108.31	108'307.50	0.09
BQUE LETTRE GAG 0.5 18-29 13/07A	22.01.29	100'000	0	0	100'000	97.38	97'376.50	0.08
CANTON DE BERNE 2.25 11-26 20/04A	20.04.26	200'000	0	0	200'000	102.24	204'471.00	0.16
CANTON DE ZURICH 1.625 13-26 29/07A	29.07.26	200'000	0	0	200'000	101.47	202'935.00	0.16
CANTON OF BERN 0.2000 21-36 26/11A	26.11.36	100'000	0	0	100'000	90.68	90'676.00	0.07
CANTON OF BERN 1.50 13-29 15/05A	15.05.29	100'000	0	0	100'000	102.71	102'709.00	0.08
CANTON OF GENEVA 1.375 14-34 29/09A	29.09.34	150'000	0	0	150'000	103.35	155'028.75	0.12
CANTON OF GENEVA 1.75 13-34 24/05A	24.05.34	100'000	0	0	100'000	106.87	106'868.50	0.08
CANTON OF ST GALLEN 0.2 16-41 28/11A	28.11.41	100'000	0	0	100'000	86.86	86'855.00	0.07
CEMBRA MONEY BANK AG 2.4113 23- 29 08/08A	08.08.29	100'000	0	0	100'000	103.12	103'124.00	0.08
CITY OF ZURICH SWITZ 1.25 24-33 25/03A	25.03.33	0	150'000	0	150'000	102.32	153'474.75	0.12

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
CITY OF ZURICH SWITZ 1.30 24-47 26/01A	26.01.47	0	200'000	0	200'000	105.22	210'434.00	0.17
CITY OF ZURICH SWITZ 1.75 23-41 23/10A	23.10.41	100'000	0	0	100'000	110.98	110'983.00	0.09
CITY OF ZURICH SWITZER 0.25 19-39 26/05A	26.05.39	100'000	0	0	100'000	89.08	89'083.50	0.07
COOP-GRUPPE GENOSSEN 0.50 17- 27 29/09A	29.09.27	100'000	0	0	100'000	97.45	97'448.00	0.08
CORNER BANCA 3.0 23-25 14/07A	14.07.25	200'000	0	0	200'000	101.32	202'640.00	0.16
EMIS FUER GEM W 1.3750 13-28 27/03A	27.03.28	200'000	0	0	200'000	101.74	203'488.00	0.16
GIVAUDAN SA 0.3750 21-30 07/06A	07.06.30	100'000	0	0	100'000	95.24	95'243.50	0.08
GRANDE DIXENCE SA 2.35 23-30 06/06A	06.06.30	200'000	0	0	200'000	104.79	209'588.00	0.17
KRAFTWERKE LINTHLIMM 2.25 23-25 05/12A	05.12.25	150'000	0	0	150'000	101.17	151'759.50	0.12
LUZERNER KANTONALB 0.10 16-31 15/09A	15.09.31	100'000	0	0	100'000	92.42	92'416.50	0.07
LUZERNER KANTONALBANK 0.40 21- 38 15/03A	15.03.38	200'000	0	0	200'000	89.12	178'247.00	0.14
MIGROS BANK AG 2.25 23-28 26/09A	26.09.28	0	100'000	0	100'000	103.26	103'264.50	0.08
NESTLE 1.625 22-25 07/11A	07.11.25	200'000	0	0	200'000	100.59	201'174.00	0.16
NESTLE 1.625 23-27 20/11A	20.11.27	100'000	0	0	100'000	101.62	101'622.74	0.08
NESTLE 2.625 22-35 08/11A	08.11.35	100'000	0	0	100'000	113.04	113'039.50	0.09
NESTLE LTD. 1.875 23-29 28/06A	28.06.29	0	200'000	0	200'000	103.36	206'715.00	0.16
NOVARTIS AG 1.6 24-27 18/06A	18.06.27	0	250'000	0	250'000	101.43	253'567.50	0.20
NOVARTIS AG 1.85 24-40 18/06A	18.06.40	0	100'000	0	100'000	105.55	105'552.00	0.08
PFANDBRIEF 0.75 18-33 21/06A	21.06.33	100'000	0	0	100'000	96.29	96'294.00	0.08
PFANDBRIEFBANK 1.75 23-43 24/03A	24.03.43	0	100'000	0	100'000	109.69	109'693.50	0.09
PFANDBRIEF SCHW 0.00 20-30 19/07A	19.07.30	100'000	0	0	100'000	93.52	93'522.00	0.07
PFANDBRIEF SCHW 0.375 17-28 24/07A	24.07.28	100'000	0	0	100'000	97.19	97'191.50	0.08
PFANDBRIEF SCHW 0.55 19-31 08/02A	29.01.31	100'000	0	0	100'000	96.36	96'362.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.125 16-28 06/09A	06.09.28	100'000	0	0	100'000	96.08	96'079.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.125 21-31 20/06A	20.06.31	150'000	0	0	150'000	93.30	139'949.25	0.11
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-26 05/08A	05.08.26	100'000	0	0	100'000	98.27	98'265.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 16-38 04/08A	04.08.38	100'000	0	0	100'000	87.50	87'501.00	0.07
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.25 17-27 18/01A	18.01.27	100'000	0	0	100'000	97.91	97'905.50	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.375 15-30 21/01	21.01.30	100'000	0	0	100'000	96.13	96'133.50	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.50 15-28 05/05A	05.05.28	100'000	0	0	100'000	97.80	97'800.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.50 16-35 05/10A	05.10.35	100'000	0	0	100'000	92.39	92'394.00	0.07
PFANDBRIEF SCHWEIZ 0.875 15-37 25/06A	25.06.37	100'000	0	0	100'000	95.93	95'929.50	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.0000 15-36 25/01A	25.01.36	150'000	0	0	150'000	97.64	146'452.50	0.12
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.00 15-32 12/05A	12.05.32	100'000	0	0	100'000	98.82	98'817.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.375 12-27 13/08A	13.08.27	100'000	0	0	100'000	100.89	100'892.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 12-27 27/04A	27.04.27	100'000	0	0	100'000	101.18	101'175.50	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.50 14-40 05/12A	05.12.40	100'000	0	0	100'000	104.54	104'544.00	0.08
PFANDBRIEF SCHWEIZ 1.75 23-43 23/12A	23.12.43	0	100'000	0	100'000	110.07	110'067.50	0.09

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
PFANDBRIEF SCHWEIZ 2.125 10-28 01/12A	01.12.28	200'000	0	0	200'000	104.43	208'863.00	0.16
PFANDBRIEF SCHWEIZ H 1.75 23-49 26/01A	26.01.49	0	150'000	0	150'000	112.86	169'287.00	0.13
PFANDBRIEF SCHWEIZ H 2.125 23-35 17/09A	17.09.35	100'000	0	0	100'000	109.51	109'506.50	0.09
PFANDBRIEF SCHWIEZ 1.50 12-33 02/08A	08.08.33	250'000	0	0	250'000	102.65	256'626.25	0.20
PFANDBRIEF SCHW KA 0.25 17-25 01/12A	01.12.25	100'000	0	0	100'000	98.76	98'759.50	0.08
PFANDBRIEF SCHW KA 0.30 16-31 06/06A	06.06.31	250'000	0	0	250'000	94.49	236'220.00	0.19
PFANDBRIEF SCHW KA 0.375 16-28 24/10A	24.10.28	100'000	0	0	100'000	97.00	96'997.50	0.08
PFANDBRIEF SCHW KA 0.375 17-26 07/12A	07.12.26	100'000	0	0	100'000	98.28	98'276.50	0.08
PFANDBRIEF SCHW KA 0.50 16-34 30/03A	30.03.34	100'000	100'000	0	200'000	93.48	186'954.00	0.15
PFANDBRIEF SCHW KA 0.625 15-29 16/07A	16.07.29	100'000	0	0	100'000	97.69	97'693.50	0.08
PFANDBRIEF SCHW KA 1.375 13-27 05/11A	05.11.27	100'000	0	0	100'000	100.94	100'942.00	0.08
PFANDBRIEF SCHW KA 1.75 11-26 02/09A	02.09.26	100'000	0	0	100'000	101.38	101'375.50	0.08
PFANDBRIEFZENTR 0.00 19-37 10/09A	10.09.37	100'000	0	0	100'000	85.04	85'037.50	0.07
PFANDBRIEFZENTRALE S 1.85 23-38 25/10A	25.10.38	200'000	0	0	200'000	108.38	216'769.00	0.17
PFANDBRIEFZENTRALE SC 0.3 19-29 05/03A	09.04.29	100'000	0	0	100'000	96.32	96'321.00	0.08
PFANDBR SCHWEIZ HYPO 2.25 10-32 13/08A	13.08.32	100'000	0	0	100'000	108.40	108'403.50	0.09
PFBRF SCHWZ HYPO 0.50 15-29 15/06A	15.06.29	100'000	0	0	100'000	97.15	97'150.50	0.08
PFBRF SCHWZ HYPO 1.375 12-29 20/09A	20.09.29	100'000	0	0	100'000	101.40	101'401.00	0.08
PFBRF SCHWZ KANTBK 0.25 17-27 06/12A	06.12.27	100'000	0	0	100'000	97.22	97'216.00	0.08
PFBRF SCHWZ KANTBK 0.65 18-33 15/02A	15.02.33	100'000	0	0	100'000	95.67	95'667.50	0.08
ROCHE KAPITALMA 0.5000 22-27 25/02A	25.02.27	150'000	0	0	150'000	98.34	147'516.00	0.12
ROCHE KAPITALMA 0.7500 22-31 25/02A	25.02.31	0	100'000	0	100'000	97.31	97'308.00	0.08
ROCHE KAPITALMARKT A 1.0 22-37 25/02A	25.02.37	150'000	0	0	150'000	95.56	143'345.25	0.11
ROCHE KAPITALMARKT A 1.6 23-28 15/09A	15.09.28	100'000	0	0	100'000	101.99	101'988.00	0.08
ROCH KA 2.0 22-32 23/09A	23.09.32	150'000	0	0	150'000	106.23	159'345.75	0.13
SANDOZ GROUP 2.6 23-31 17/11A	17.11.31	100'000	0	0	100'000	105.98	105'982.00	0.08
ST COOP CENT D'EMI 1.70 23-41 29/04A	29.04.41	150'000	0	0	150'000	110.78	166'176.00	0.13
ST GALLER KANTONAL 0.625 17-32 23/01A	23.01.32	100'000	0	0	100'000	95.84	95'836.00	0.08
SWITZERLAND 0.00 16-29 22/06U	22.06.29	150'000	50'000	0	200'000	97.03	194'050.00	0.15
SWITZERLAND 0.25 21-35 23/06A	23.06.35	0	100'000	0	100'000	97.01	97'009.50	0.08
SWITZERLAND 0.5000 18-32 27/06A	27.06.32	150'000	0	0	150'000	99.63	149'442.75	0.12
SWITZERLAND 0.50 15-30 27/05A	27.05.30	150'000	0	0	150'000	99.63	149'451.75	0.12
SWITZERLAND 0.5 17-45 28/06A	28.06.45	150'000	0	0	150'000	99.08	148'626.75	0.12
SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	26.06.34	100'000	0	0	100'000	94.85	94'854.50	0.07
SWITZERLAND 0 19-39 24/07U	24.07.39	100'000	50'000	0	150'000	92.31	138'471.75	0.11
SWITZERLAND 1.25 12-37 27/06A	27.06.37	150'000	0	0	150'000	109.09	163'629.00	0.13
SWITZERLAND 1.25 14-26 28/05A	28.05.26	150'000	0	0	150'000	100.95	151'428.00	0.12
SWITZERLAND 1.25 23-43 28/06A	28.06.43	0	100'000	0	100'000	112.70	112'700.00	0.09
SWITZERLAND 1.50 12-42 30/04A	30.04.42	150'000	0	0	150'000	116.17	174'255.00	0.14
SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	24.07.25	150'000	0	0	150'000	100.65	150'971.25	0.12

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anleihen								
SWITZERLAND 1.5 22-38 26/10A	26.10.38	0	100'000	0	100'000	113.31	113'311.00	0.09
SWITZERLAND 2.25 11-31 22/06A	22.06.31	150'000	0	0	150'000	111.65	167'474.25	0.13
SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	08.03.36	150'000	50'000	0	200'000	122.43	244'863.00	0.19
SWITZERLAND 3.25 07-27 27/06A	27.06.27	150'000	0	0	150'000	107.62	161'433.75	0.13
SWITZERLAND 3.50 03-33 08/04A	08.04.33	200'000	0	0	200'000	125.35	250'699.00	0.20
SWITZERLAND 4.00 98-28 08/04A	08.04.28	200'000	50'000	0	250'000	112.47	281'170.00	0.22
SWITZERLAND GOVERNME 0.875 24-47 22/05A	22.05.47	0	150'000	0	150'000	106.76	160'140.00	0.13
VILLE DE BERN 1.5 13-28 25/02A	25.02.28	200'000	0	0	200'000	102.09	204'184.00	0.16
ZUERCHER KANTONALB 0.25 17-26 27/01A	27.01.26	100'000	0	0	100'000	98.52	98'524.00	0.08
<i>Schweiz</i>							14'310'488.24	11.27
BANCO SANTANDER ALL 2.24 24-32 16/02A	16.02.32	0	150'000	0	150'000	104.43	156'644.25	0.12
<i>Spanien</i>							156'644.25	0.12
BANK OF AMERICA CORP 0.2525 19-26 12/06A	12.06.26	100'000	0	0	100'000	98.02	98'015.50	0.08
COCA-COLA CO 1.00 15-28 02/10A	02.10.28	100'000	0	0	100'000	100.20	100'204.00	0.08
VERIZON COMM 0.555 21-31 24/03A	24.03.31	0	100'000	0	100'000	94.50	94'496.00	0.07
VERIZON COMM 1 17-27 30/11A	30.11.27	150'000	0	0	150'000	98.91	148'370.25	0.12
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>							441'085.75	0.35
Schweizer Franken							18'695'204.99	14.73
Die an einer Börse gehandelt Effekten							18'695'204.99	14.73
PFANDBRIEFZENTRALE SC 1.45 22-30 30/04A	30.04.30	150'000	0	0	150'000	101.92	152'886.75	0.12
PFANDBRIEFZENTRALE SC 1.8 22-36 23/05A	23.05.36	200'000	0	0	200'000	106.43	212'863.00	0.17
<i>Schweiz</i>							365'749.75	0.29
Schweizer Franken							365'749.75	0.29
Übertragbare Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind und nach am Markt beobachtbaren Parametern bewertet werden							365'749.75	0.29
Anleihen							19'060'954.74	15.01
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere							19'060'954.74	15.01

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Anteile in Investmentfonds							
ISHARES CORE MSCI EM IMI UCITS ETF	69'250	0	19'900	49'350	34.31	1'521'469.39	1.20
ISHARES III ISHARES CORE MSCI WLD UCITS	83'000	49'700	28'500	104'200	101.98	9'548'564.15	7.52
SPDR MSCI WORLD SMALL CAP UCITS ETF	55'900	3'000	0	58'900	100.84	5'337'077.08	4.20
SPDR MSCI WORLD UCITS ETF	281'000	13'000	0	294'000	37.27	9'846'050.67	7.76
UBS EQUIT DEFEN PUTWRITE ST ETF A USD	2'650	0	2'650	0	0.00	0.00	0.00
WISDOMTREE ENH CMDTY EX AGRI UCITS ETF	53'000	0	0	53'000	11.80	561'731.99	0.44
XTRACKERS MSCI EMERGING MKTS UCITS 1CC	26'500	10'100	0	36'600	56.56	1'860'140.85	1.47
<i>Irland</i>						28'675'034.13	22.59
ISHARES RUSSEL 2000 ETF FUND	1'200	0	1'200	0	0.00	0.00	0.00
ISHARES SHORT TREASURY BOND ETF	200	0	0	200	110.50	19'858.55	0.02
SPDR S&P500 ETF TRUST	1'400	0	1'400	0	0.00	0.00	0.00
<i>Vereinigte Staaten von Amerika</i>						19'858.55	0.02
Dollar Us						28'694'892.68	22.60
XTRACKERS MSCI WORLD INDEX UCITS-1C CAP	87'700	0	0	87'700	100.42	8'806'834.00	6.94
XTRACKERS MSCI WORLD UCITS ETF 1D	33'000	0	0	33'000	85.18	2'810'940.00	2.21
<i>Irland</i>						11'617'774.00	9.15
ISHS CORE SPIE ETF -A-	15'700	18'000	18'000	15'700	144.28	2'265'196.00	1.78
SCHRODER IMM PLUS	2'357	0	0	2'357	159.50	375'941.50	0.30
SWISSINVEST RE INV	5'040	0	0	5'040	192.50	970'200.00	0.76
UBS SXI RE FD - ANTEILE -(CHF) A- DIS-	43'000	118'000	0	161'000	9.08	1'462'524.00	1.15
ZKB GOLD ETF -A CHF-	1'000	0	0	1'000	623.90	623'900.00	0.49
<i>Schweiz</i>						5'697'761.50	4.49
Schweizer Franken						17'315'535.50	13.64
Die an einer Börse gehandelt Effekten						46'010'428.18	36.24
LEADENHALL ILS FD PLC CL H2	11'070	0	0	11'070	120.87	1'202'388.84	0.95
VANGUARD GLB SMALL CAP INX USD C	14'100	0	0	14'100	349.37	4'426'494.63	3.49
<i>Irland</i>						5'628'883.47	4.43
BLUEORCHARD MICROFINANCE FUND I USD	85	0	0	85	15'362.49	1'173'372.44	0.92
GLOBAL SENIOR LOAN FUND EB CAP	500	0	0	500	1'405.62	631'528.97	0.50
MS INV F GLOBAL CONVERT BOND Z ACC	24'400	0	0	24'400	49.63	1'088'151.70	0.86
<i>Luxemburg</i>						2'893'053.11	2.28
Dollar Us						8'521'936.58	6.71

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
UBS EUR EQUIT DEFEN PUTWRITE SF ETF A EU	2'200	0	2'200	0	0.00	0.00	0.00
<i>Irland</i>						0.00	0.00
Euro						0.00	0.00
CSIMF SWISS REAL ESTATE SECURITIES EB	960	0	0	960	1'899.87	1'823'875.20	1.44
HELVETIA CH SWISS PROPERTY FUND	23'720	0	12'987	10'733	108.00	1'159'164.00	0.91
<i>Schweiz</i>						2'983'039.20	2.35
Schweizer Franken						2'983'039.20	2.35
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelter, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden						11'504'975.78	9.06
Anteile in Investmentfonds						57'515'403.96	45.30

Inventar des Vermögens

Titelbezeichnung	Verfall	Anzahl per 31.12.23	Käufe	Verkäufe	Anzahl per 28.06.24	Kurs	Verkehrswert CHF	in %
Strukturierte Produkte								
SG ISSUER CV 0.00 23-24 11/12A	11.12.24	10'600	0	0	10'600	432.10	4'115'716.72	3.24
SOCIETE GENERALE(MSCI) ZCP 23-24 07/11U	07.11.24	8'894	0	0	8'894	432.20	3'454'118.49	2.72
<i>Luxemburg</i>							7'569'835.21	5.96
BNP PARIBAS ISSUANCE BV ZCP 23-24 28/02U	28.02.24	13'000	0	13'000	0	0.00	0.00	0.00
<i>Niederlande</i>							0.00	0.00
Dollar Us							7'569'835.21	5.96
Die an einer Börse gehandelt Effekten							7'569'835.21	5.96
UBS LONDON PERLES 2013 13-XX 31/12U	31.12.99	12'400	0	0	12'400	431.85	4'811'826.42	3.79
<i>Großbritannien</i>							4'811'826.42	3.79
Dollar Us							4'811'826.42	3.79
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, der Öffentlichkeit zugänglichen Markt gehandelt werden							4'811'826.42	3.79
Strukturierte Produkte							12'381'661.63	9.75

Inventar des Vermögens

	Verfall	Käufe	Devisen	Verkäufe	Devisen	Verkehrswert CHF	in %
Derivative Finanzinstrumente							
Devisentermingeschäfte ¹							
	15.11.24	3'019'346.20	CHF	3'400'000.00	USD	13'789.26	0.01
	12.08.24	2'261'191.68	CHF	2'640'000.00	USD	-99'318.41	-0.08
	15.05.24	3'013'705.60	CHF	3'400'000.00	USD	0.00	0.00
	12.02.24	2'268'042.48	CHF	2'640'000.00	USD	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte						-85'529.15	-0.07
Derivative Finanzinstrumente						-85'529.15	-0.07

¹ Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften: Zuercher Kantonalbank

Titelbezeichnung	Verkehrswert CHF	in %
Bankguthaben		
Sichtguthaben	1'307'143.35	1.03
Bankguthaben	1'307'143.35	1.03

Devisenkurs

1 EUR	=	CHF	0.96305
1 GBP	=	CHF	1.13587
1 USD	=	CHF	0.89858

Derivate unter Anwendung des Commitment-Ansatzes I

Engagement-reduzierende Positionen	
Devisentermingeschäfte	5'366'067.03
Total in CHF	5'366'067.03
Total in % des Nettofondsvermögens	4.25

Angaben früherer Jahre

Datum	Klasse	Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹		Anzahl Anteile im Umlauf	Nettofondsvermögen	Thesaurierung des Nettoertrags je Anteil
31.12.22	Klasse A1	CHF	106.43	625'106.263	66'531'033.26	0.7806
31.12.23	Klasse A1	CHF	113.33	688'420.301	78'021'238.53	0.987
28.06.24	Klasse A1	CHF	125.18	688'420.301	86'178'739.37	0.00
31.12.22	Klasse A2	CHF	105.36	233'452.180	24'597'118.49	0.7659
31.12.23	Klasse A2	CHF	111.86	233'452.180	26'114'306.85	0.6465
28.06.24	Klasse A2	CHF	123.49	233'452.180	28'829'901.64	0.00
31.12.22	Klasse R1	CHF	106.43	68'072.000	7'244'969.48	0.7802
31.12.23	Klasse R1	CHF	113.33	83'298.000	9'440'432.84	0.987
28.06.24	Klasse R1	CHF	125.18	86'340.000	10'808'286.39	0.00
31.12.22	Klasse E	CHF	86.63	774.117	67'061.81	0.6292
31.12.23	Klasse E	CHF	92.62	1'563.662	144'826.79	1.1689
28.06.24	Klasse E	CHF	102.37	3'844.558	393'584.57	0.00

¹ Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP.