

# SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE RELAX

## Halbjahresbericht per 31.03.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	237924	CHF
CT CHF	37873489	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	21
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	21
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	22
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	22
8	Pauschale Verwaltungskommission	22
9	Benchmark	23
10	TER	23
11	Fussnoten	23
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		316'087'451.89	320'696'091.07	357'680'601.00	481'428'575.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'080'347.280	-	-	-
<b>Klasse AA CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		295'249'121.94	298'386'968.90	329'659'232.55	443'126'405.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		310'439.040	329'301.973	366'335.769	421'391.501
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		951.0696	906.1196	899.8827	1'051.5800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		949.0723	904.2167	897.9030	1'052.1000
Ausschüttung je Anteil		-	7.25	6.05	5.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.97 %	0.98 %	0.97 %	1.00 %
<b>Klasse CT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'838'329.95	22'309'122.17	28'021'368.45	38'302'170.90
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		204'721.598	231'361.069	294'619.965	346'711.582
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		101.7886	96.4256	95.1102	110.4700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		101.5749	96.2231	94.9010	110.5300
Thesaurierung je Anteil		-	1.16	1.06	1.01
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.56 %	0.57 %	0.56 %	0.59 %

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

#### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	5.79 %	4.17 %	-13.74 %	1.11 %
Klasse CT CHF	6.00 %	4.60 %	-13.38 %	1.53 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

#### Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.03.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	4'864'804.94	5'778'568.92
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	48'238'374.99	45'200'626.29
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'413'057.50	208'218'405.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	257'721'768.97	60'062'666.31
Andere Anlagen - Metallkonten	1'543'715.94	1'711.13
Derivative Finanzinstrumente	73'905.80	-239'480.85
Sonstige Vermögenswerte	462'458.53	1'902'646.59
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>316'318'086.67</b>	<b>320'925'143.39</b>
Andere Verbindlichkeiten	-230'634.78	-229'052.32
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>316'087'451.89</b>	<b>320'696'091.07</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		329'301.973	366'335.769
Ausgegebene Anteile		3'876.502	5'859.685
Zurückgenommene Anteile		-22'739.435	-42'893.481
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>310'439.040</b>	<b>329'301.973</b>
<b>Klasse CT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		231'361.069	294'619.965
Ausgegebene Anteile		900.000	10'821.031
Zurückgenommene Anteile		-27'539.471	-74'079.927
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>204'721.598</b>	<b>231'361.069</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		320'696'091.07	357'680'601.00
Ausbezahlte Ausschüttung		-2'294'957.82	-2'156'246.76
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-87'071.21	-103'171.22
Saldo aus dem Anteilverkehr		-19'992'506.46	-39'858'638.72
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		17'765'896.31	5'133'546.77
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>316'087'451.89</b>	<b>320'696'091.07</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		75'358.32	82'343.73
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-888.01	-1'711.16
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		413'993.00	1'071'717.96
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'348'327.84	3'199'833.92
Erträge der Gratisaktien		52.87	56.25
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		335'581.11	1'350'716.80
Erträge aus Wertpapierleihe		26'174.30	75'976.30
Sonstige Erträge		2.59	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'023.16	18'438.64
<b>Total Ertrag</b>		<b>2'203'625.18</b>	<b>5'797'372.44</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-668.92
Reglementarische Vergütungen		-1'361'390.13	-2'978'110.13
Sonstige Aufwendungen		-377.37	-534.64
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-30'933.07	-159'293.04
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'392'700.57</b>	<b>-3'138'606.73</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			
		<b>810'924.61</b>	<b>2'658'765.71</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-30'016'733.74	-6'620'575.52
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		1'777.10	81'537.53
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		49'718.73	95'667.41
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-29'154'313.30</b>	<b>-3'784'604.87</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		46'920'209.61	8'918'151.64
<b>Gesamterfolg</b>		<b>17'765'896.31</b>	<b>5'133'546.77</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>81'451'977.60</b>	<b>25.75</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>48'238'374.99</b>	<b>15.25</b>	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	4'166	0	0	4'166 AUD	43.00	105'264.48	0.03	a)
AU000000ANZ3	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	0	543	0	543 AUD	29.40	9'380.83	0.00	a)
AU000000APA1	APA GROUP	6'513	0	6'513	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	0	7'849	0	7'849 AUD	25.70	118'533.63	0.04	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	13'670	13'255	26'925	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	5'458	20'452	25'910	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	11'656	0	0	11'656 AUD	18.13	124'177.08	0.04	a)
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	1'178	0	512	666 AUD	121.76	47'651.11	0.02	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	25'080	0	25'080 AUD	3.39	49'959.88	0.02	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	1'580	1'112	2'692	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	7'991	0	7'991	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	0	24'917	0	24'917 AUD	2.13	31'186.70	0.01	a)
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	17'107	13'950	0	31'057 AUD	5.51	100'555.36	0.03	a)
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5'187	4'904	5'187	4'904 AUD	30.50	87'891.00	0.03	a)
<b>AUD</b>							<b>674'600.07</b>	<b>0.21</b>	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	1'717	6'563	1'717	6'563 CAD	24.15	105'492.52	0.03	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	5'358	0	5'358	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	0	1'247	377	870 CAD	77.31	44'766.90	0.01	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	3'576	0	3'576 CAD	29.92	71'213.32	0.02	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	1'695	0	1'695 CAD	56.90	64'192.47	0.02	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	0	3'961	1'951	2'010 CAD	68.67	91'868.21	0.03	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	198	0	198	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	3'514	824	3'514	824 CAD	30.85	16'919.38	0.01	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	491	413	904	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	1'608	0	1'608	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	2'588	0	2'588 CAD	8.31	14'314.21	0.00	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	1'045	0	1'045 CAD	150.10	104'399.67	0.03	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	6'718	0	0	6'718 CAD	33.83	151'266.98	0.05	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	1'492	0	1'492	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	5'387	0	0	5'387 CAD	22.13	79'347.00	0.03	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	807	1'731	1'383	1'155 CAD	73.59	56'572.18	0.02	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1'616	0	1'616	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	2'398	0	2'398	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA70137W1086	PARKLAND CORP	1'599	507	2'106	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	3'427	0	3'427 CAD	47.81	109'052.34	0.03	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	1'450	2'520	0	3'970 CAD	37.98	100'356.98	0.03	a)
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	0	475	475	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	1'312	1'312	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	1'477	1'441	1'477	1'441 CAD	73.91	70'887.44	0.02	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	3'433	0	3'433	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	682	1'700	2'382	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
<b>CAD</b>							<b>1'080'649.60</b>	<b>0.34</b>	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	392	195	0	587 CHF	551.40	323'671.80	0.10	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	130	23	48	105 CHF	4'016.00	421'680.00	0.13	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2'377	13	0	2'390 CHF	486.30	1'162'257.00	0.37	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	25'119	536	463	25'192 CHF	87.37	2'201'025.04	0.70	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9'813	230	387	9'656 CHF	229.70	2'217'983.20	0.70	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	4'881	0	653	4'228 CHF	81.66	345'258.48	0.11	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	17'410	100	997	16'513 CHF	41.89	691'729.57	0.22	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	638	245	91	792 CHF	261.10	206'791.20	0.07	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	1'529	150	298	1'381 CHF	540.20	746'016.20	0.24	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	719	4	0	723 CHF	632.20	457'080.60	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	430	0	5	425 CHF	1'288.00	547'400.00	0.17	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	838	0	838 CHF	251.00	210'338.00	0.07	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	211	33	46	198 CHF	533.00	105'534.00	0.03	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	37'561	239	1'456	36'344 CHF	95.75	3'479'938.00	1.10	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	1'525	0	176	1'349 CHF	115.95	156'416.55	0.05	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7'521	1'086	752	7'855 CHF	137.50	1'080'062.50	0.34	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	39'265	222	1'773	37'714 CHF	27.74	1'046'186.36	0.33	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	1'357	351	0	1'708 CHF	268.60	458'768.80	0.15	a)
CH0432492467	ALCON INC	11'047	0	1'021	10'026 CHF	74.74	749'343.24	0.24	a)
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	5'023	5'023	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>CHF</b>							<b>16'607'480.54</b>	<b>5.25</b>	
DK0010181759	CARLSBERG AS-B	0	98	98	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	839	0	138	701 DKK	1'114.50	101'887.34	0.03	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	724	713	1'437	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	2'400	677	1'120	1'957 DKK	881.30	224'924.49	0.07	a)
<b>DKK</b>							<b>326'811.83</b>	<b>0.10</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	778	0	0	778 EUR	41.30	31'255.87	0.01	a)
BE0003565737	KBC GROUP NV	1'057	245	0	1'302 EUR	69.42	87'922.01	0.03	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	574	0	574	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	187	187	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CRH ID	CRH PLC	1'438	0	1'438	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5'529	2'308	2'880	4'957 EUR	14.58	70'313.38	0.02	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	682	0	682 EUR	66.90	44'382.58	0.01	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	1'572	1'407	1'572	1'407 EUR	74.50	101'965.29	0.03	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	364	0	364	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	1'340	1'148	2'488	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	838	354	277	915 EUR	180.46	160'621.64	0.05	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	1'168	0	207	961 EUR	176.96	165'424.76	0.05	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	419	0	419 EUR	277.80	113'226.55	0.04	a)
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	612	0	612	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	8'222	0	0	8'222 EUR	12.89	103'053.77	0.03	a)
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	1'266	0	1'266	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	4'800	0	0	4'800 EUR	11.04	51'548.06	0.02	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	271	588	0	859 EUR	112.85	94'296.75	0.03	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2'253	0	2'253	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	5'548	0	5'548 EUR	15.81	85'296.84	0.03	a)
FI0009007884	ELISA OYJ	904	1'246	0	2'150 EUR	41.35	86'480.06	0.03	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	890	0	890	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	7'112	0	7'112 EUR	13.82	95'581.99	0.03	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	933	1'556	808	1'681 EUR	63.47	103'785.87	0.03	a)
FR0000120578	SANOFI	850	0	850	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	4'818	1'499	2'176	4'141 EUR	34.82	140'240.56	0.04	a)
FR0000120644	DANONE	2'056	0	0	2'056 EUR	59.89	119'778.65	0.04	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	69	0	28	41 EUR	833.70	33'250.31	0.01	a)
FR0000121220	SODEXO SA	290	0	290	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	295	295	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	1'554	0	0	1'554 EUR	24.00	36'279.75	0.01	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	377	741	377	741 EUR	209.65	151'117.61	0.05	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2'207	0	2'207	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	1'064	0	798	266 EUR	101.05	26'146.89	0.01	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	3'807	205	4'012	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	2'350	353	574	2'129 EUR	65.86	136'395.30	0.04	a)
FR0010208488	ENGIE	2'343	4'127	1'614	4'856 EUR	15.51	73'264.31	0.02	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	1'240	0	1'240	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	2'153	2'262	4'415	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	1'654	0	1'654 EUR	41.04	66'030.54	0.02	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	3'153	0	3'153 EUR	35.52	108'942.90	0.03	a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	876	0	876 EUR	42.27	36'019.56	0.01	a)
IE00BFOL3536	AIB GROUP PLC	9'513	1'266	10'779	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	5'912	720	1'382	5'250 EUR	23.46	119'808.97	0.04	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	35'661	0	0	35'661 EUR	3.36	116'660.11	0.04	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0003128367	ENEL SPA	0	2'099	2'099	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	4'398	0	0	4'398 EUR	11.61	49'648.07	0.02	a)
NL000009082	KONINKLIJKE KPN NV	27'295	0	27'295	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	3'304	0	3'304	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	973	0	158	815 EUR	145.20	115'113.49	0.04	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	87	14	0	101 EUR	892.20	87'656.80	0.03	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1'494	0	1'494	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011821202	ING GROEP NV	0	1'539	0	1'539 EUR	15.25	22'824.25	0.01	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	682	1'245	682	1'245 EUR	69.18	83'782.23	0.03	a)
NL0015000IY2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	1'624	1'624	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	2'028	0	2'028	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>EUR</b>							<b>2'918'115.72</b>	<b>0.92</b>	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	3'951	10'608	0	14'559 GBP	671.40	111'219.87	0.04	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	25'053	0	14'880	10'173 GBP	619.00	71'648.84	0.02	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	8'292	0	8'292 GBP	1'042.00	98'309.73	0.03	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	1'465	0	1'465 GBP	5'017.00	83'627.90	0.03	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	229	0	0	229 GBP	10'678.00	27'822.42	0.01	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	36'974	0	27'753	9'221 GBP	183.20	19'220.86	0.01	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	3'330	3'092	0	6'422 GBP	1'213.00	88'634.05	0.03	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	16'553	0	16'553 GBP	270.40	50'927.56	0.02	a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	62'375	11'677	14'924	59'128 GBP	127.65	85'878.31	0.03	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	2'056	761	2'817	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	0	340	340	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	4'067	0	4'067	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	3'522	0	0	3'522 GBP	3'424.00	137'212.15	0.04	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	3'032	0	3'032	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	1'225	0	1'225	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	113'847	0	113'847	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	6'229	0	6'229 GBP	220.50	15'627.75	0.00	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	35'147	0	6'822	28'325 GBP	296.60	95'589.58	0.03	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	22'683	22'683	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	9'265	0	9'265 GBP	831.20	87'623.47	0.03	a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	1'966	913	0	2'879 GBP	1'708.60	55'969.51	0.02	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	7'745	3'030	6'566	4'209 GBP	2'625.00	125'712.28	0.04	a)
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	5'718	0	5'718 GBP	700.20	45'554.97	0.01	a)
GB00BYW0PQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	5'211	0	5'211 GBP	658.20	39'025.49	0.01	a)
IE0001827041	CRH PLC	0	1'438	411	1'027 GBP	6'828.00	79'787.24	0.03	a)
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	793	0	130	663 GBP	17'291.11	130'438.56	0.04	a)
<b>GBP</b>							<b>1'449'830.54</b>	<b>0.46</b>	
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	21'000	0	21'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	59'000	38'000	97'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	1'500	0	1'500 HKD	85.65	14'785.43	0.00	a)
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	19'000	19'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0823032773	LINK REIT	11'000	5'300	11'000	5'300 HKD	33.65	20'524.68	0.01	a)
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	39'500	2'500	0	42'000 HKD	20.95	101'262.51	0.03	a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	0	14'500	14'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	21'200	21'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	6'000	0	6'000 HKD	25.45	17'573.34	0.01	a)
<b>HKD</b>							<b>154'145.96</b>	<b>0.05</b>	
NO0010096985	EQUINOR ASA	2'294	0	2'294	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	2'441	0	2'441 NOK	269.80	54'678.45	0.02	a)
<b>NOK</b>							<b>54'678.45</b>	<b>0.02</b>	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	1'014	0	0	1'014 NZD	34.25	18'710.65	0.01	a)
<b>NZD</b>							<b>18'710.65</b>	<b>0.01</b>	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	3'555	0	3'555	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	6'675	0	2'160	4'515 SEK	174.58	66'397.10	0.02	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	5'743	0	913	4'830 SEK	290.10	118'029.81	0.04	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	2'099	1'005	3'104	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	4'276	4'276	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	2'895	0	2'895 SEK	307.10	74'890.24	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>SEK</b>							<b>259'317.15</b>	<b>0.08</b>	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	13'800	0	2'100	11'700 SGD	13.49	105'335.05	0.03	a)
<b>SGD</b>							<b>105'335.05</b>	<b>0.03</b>	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	1'613	0	1'613 USD	54.81	79'629.56	0.03	a)
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	19'516	0	19'516 USD	6.10	107'260.86	0.03	a)
BMG491BT1088	INVESCO LTD	4'433	2'437	6'870	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	750	750	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	588	0	261	327 USD	69.95	20'602.30	0.01	a)
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	503	0	503	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059YS762	LINDE PLC	161	0	89	72 USD	464.32	30'111.34	0.01	a)
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	343	428	132	639 USD	346.61	199'490.45	0.06	a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	265	0	265	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	770	0	662	108 USD	312.68	30'416.13	0.01	a)
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	562	79	483 USD	300.20	130'598.44	0.04	a)
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	1'663	0	0	1'663 USD	85.44	127'977.51	0.04	a)
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	1'636	1'636	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2'178	0	2'178	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	294	0	0	294 USD	164.01	43'430.80	0.01	a)
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3'814	0	3'814	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	205	0	205 USD	86.91	16'047.37	0.01	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	398	398	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	676	0	0	676 USD	247.77	150'860.51	0.05	a)
US00206R1023	AT&T INC	8'629	1'867	7'573	2'923 USD	17.60	46'336.33	0.01	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	795	0	648	147 USD	113.66	15'048.91	0.00	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	536	842	114	1'264 USD	182.10	207'318.08	0.07	a)
US00724F1012	ADOBE INC	483	68	68	483 USD	504.60	219'520.23	0.07	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	631	135	0	766 USD	180.49	124'526.58	0.04	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	222	0	222 USD	108.76	21'747.15	0.01	a)
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	3'819	0	3'819	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	3'432	0	1'718	1'714 USD	152.26	235'058.96	0.07	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	4'569	629	0	5'198 USD	150.93	706'629.90	0.22	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	677	0	677	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0231351067	AMAZON.COM INC	6'236	363	505	6'094 USD	180.38	990'081.61	0.31	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	995	0	122	873 USD	227.69	179'035.17	0.06	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	819	604	819	604 USD	197.59	107'493.47	0.03	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	427	122	549	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	0	230	0	230 USD	438.44	90'827.67	0.03	a)
US0311621009	AMGEN INC	499	156	0	655 USD	284.32	167'737.00	0.05	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	0	3'011	3'011	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	348	0	348	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	251	104	0	355 USD	518.54	165'802.39	0.05	a)
US0378331005	APPLE INC	10'390	0	2'351	8'039 USD	171.48	1'241'639.92	0.39	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	0	994	0	994 USD	206.23	184'636.85	0.06	a)
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	804	804	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	110	401	0	511 USD	260.42	119'860.31	0.04	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	98	578	0	676 USD	249.74	152'059.99	0.05	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	8	4	12	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	200	200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	1'839	0	0	1'839 USD	37.92	62'810.21	0.02	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3'052	0	590	2'462 USD	57.62	127'773.70	0.04	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	481	0	481	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	60	0	8	52 USD	3'627.88	169'916.84	0.05	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	1'019	0	1'019	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	1'380	210	1'170 USD	65.31	68'824.92	0.02	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2'925	366	0	3'291 USD	54.23	160'748.77	0.05	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	570	0	0	570 USD	204.86	105'174.92	0.03	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	219	80	88	211 USD	1'325.41	251'891.12	0.08	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0	301	301	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	575	254	427	402 USD	208.55	75'512.08	0.02	a)
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0	325	325	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	0	597	119	478 USD	363.19	156'365.86	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US1264081035	CSX CORP	0	1'598	0	1'598 USD	37.07	53'355.54	0.02	a)
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	4'090	0	4'090	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	592	0	592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	2'378	0	2'378	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	425	557	0	982 USD	148.89	131'691.33	0.04	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	1'061	795	741	1'115 USD	111.90	112'378.99	0.04	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	442	240	83	599 USD	366.43	197'696.06	0.06	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	0	408	0	408 USD	78.48	28'840.27	0.01	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	239	80	319	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	781	781	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	1'815	301	1'660	456 USD	157.74	64'786.85	0.02	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	55	0	21	34 USD	2'906.77	89'016.34	0.03	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	1'240	1'108	1'240	1'108 USD	104.31	104'098.83	0.03	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	4'480	435	698	4'217 USD	49.91	189'570.75	0.06	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	218	0	218 USD	687.03	134'900.13	0.04	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	0	2'026	0	2'026 USD	63.24	115'401.50	0.04	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	604	604	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	4'295	774	3'618	1'451 USD	61.18	79'957.10	0.03	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	154	0	154 USD	73.29	10'165.89	0.00	a)
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	0	1'612	0	1'612 USD	90.05	130'746.15	0.04	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	5'000	598	648	4'950 USD	43.35	193'274.46	0.06	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	1'658	116	1'774	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	1'381	0	0	1'381 USD	90.81	112'955.54	0.04	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	0	1'194	0	1'194 USD	57.67	62'020.38	0.02	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	98	0	0	98 USD	732.63	64'668.22	0.02	a)
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	1'295	697	1'380	612 USD	105.83	58'336.50	0.02	a)
US2358511028	DANAHER CORP	78	0	78	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	691	83	691	83 USD	167.15	12'495.82	0.00	a)
US23918K1088	DAVITA INC	447	469	678	238 USD	138.05	29'593.31	0.01	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	186	0	168	18 USD	941.26	15'260.27	0.00	a)
US2441991054	DEERE & CO	0	115	0	115 USD	410.74	42'544.65	0.01	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	403	0	403	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	2'677	0	2'677 USD	50.18	120'992.71	0.04	a)
US2521311074	DEXCOM INC	304	0	304	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	1'146	512	634 USD	198.17	113'163.75	0.04	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	0	89	0	89 USD	122.36	9'808.66	0.00	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1'333	0	756	577 USD	131.09	68'127.98	0.02	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	239	0	239 USD	59.55	12'819.17	0.00	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	29	0	29 USD	496.88	12'978.65	0.00	a)
US2605571031	DOW INC	2'363	0	2'363	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	1'418	0	0	1'418 USD	24.30	31'035.78	0.01	a)
US2786421030	EBAY INC	1'665	889	0	2'554 USD	52.78	121'414.47	0.04	a)
US2788651006	ECOLAB INC	765	0	765	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1'564	0	566	998 USD	95.56	85'898.75	0.03	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	0	962	0	962 USD	132.67	114'955.03	0.04	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	1'442	1'122	1'442	1'122 USD	113.42	114'620.60	0.04	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	109	0	109 USD	120.98	11'877.37	0.00	a)
US29444U7000	EQUINIX INC	185	140	185	140 USD	825.33	104'072.46	0.03	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	1'418	2'430	736	3'112 USD	38.01	106'541.21	0.03	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	0	1'626	1'626	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	1'955	0	1'955	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	1'622	0	201	1'421 USD	116.24	148'774.96	0.05	a)
US3024913036	FMC CORP	1'613	1'083	2'437	259 USD	63.70	14'860.02	0.00	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	1'039	46	0	1'085 USD	485.58	474'537.67	0.15	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	361	0	361	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3156161024	F5 INC	0	61	0	61 USD	189.59	10'416.59	0.00	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2'155	646	1'798	1'003 USD	74.18	67'014.37	0.02	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	2'641	0	2'641	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	819	0	819	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	1'616	443	1'616	443 USD	86.02	34'322.85	0.01	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	0	1'438	0	1'438 USD	84.67	109'665.14	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	703	703	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	720	2'088	0	2'808 USD	28.62	72'384.72	0.02	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	823	823	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	1'993	0	0	1'993 USD	69.97	125'602.80	0.04	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	351	216	567	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	2'174	379	413	2'140 USD	73.25	141'189.23	0.04	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	0	435	0	435 USD	417.69	163'652.82	0.05	a)
US3841091040	GRACO INC	892	0	892	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	VW GRAINGER INC	164	0	164	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	487	0	487	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	1'448	0	1'448 USD	103.05	134'399.21	0.04	a)
US4180561072	HASBRO INC	0	2'822	700	2'122 USD	56.52	108'025.85	0.03	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	0	397	397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0	158	0	158 USD	213.31	30'356.27	0.01	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	1'483	0	1'483	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	305	564	0	869 USD	383.60	300'246.90	0.09	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	0	5'712	0	5'712 USD	20.68	106'394.43	0.03	a)
US4435106079	HUBBELL INC	295	0	0	295 USD	415.05	110'281.48	0.03	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	39	0	39	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	0	332	0	332 USD	346.72	103'680.51	0.03	a)
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	0	9'210	9'210	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	0	201	0	201 USD	137.32	24'860.51	0.01	a)
US45337C1027	INCYTE CORP	1'810	0	0	1'810 USD	56.97	92'876.31	0.03	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	1'307	0	1'307 USD	94.95	111'776.55	0.04	a)
US45784P1012	INSULET CORP	0	256	0	256 USD	171.40	39'521.27	0.01	a)
US4581401001	INTEL CORP	0	2'317	963	1'354 USD	44.17	53'867.43	0.02	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	1'029	203	139	1'093 USD	190.96	187'993.46	0.06	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	1'931	1'417	0	3'348 USD	39.02	117'666.51	0.04	a)
US4612021034	INTUIT INC	375	24	65	334 USD	650.00	195'541.97	0.06	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	233	89	233	89 USD	399.09	31'991.97	0.01	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	1'561	336	1'595	302 USD	80.21	21'818.03	0.01	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	1'863	0	392	1'471 USD	200.30	265'383.42	0.08	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	882	1'242	0	2'124 USD	158.19	302'631.20	0.10	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	991	1'248	991	1'248 USD	37.06	41'658.17	0.01	a)
US4878361082	KELLANOVA	1'860	1'125	907	2'078 USD	57.29	107'227.09	0.03	a)
US49177J1025	KENVUE INC	0	2'372	2'372	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	3'731	3'731	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	4'743	0	4'743 USD	15.81	67'540.64	0.02	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	867	85	867	85 USD	156.38	11'972.37	0.00	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	781	230	0	1'011 USD	129.35	117'787.11	0.04	a)
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	0	1'710	1'710	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	0	12'520	5'795	6'725 USD	18.34	111'089.19	0.04	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	2'918	0	2'918 USD	36.90	96'982.15	0.03	a)
US5018892084	LKQ CORP	0	2'287	2'287	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	696	120	576 USD	218.46	113'337.75	0.04	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	230	0	49	181 USD	971.57	158'391.85	0.05	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	696	0	232	464 USD	777.96	325'128.78	0.10	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	484	319	484	319 USD	254.73	73'189.86	0.02	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	3'307	17'165	20'472	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	3'015	1'238	0	4'253 USD	28.34	108'561.39	0.03	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	678	172	291	559 USD	201.50	101'453.50	0.03	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	827	0	290	537 USD	481.57	232'923.80	0.07	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	132	0	0	132 USD	281.95	33'521.71	0.01	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	137	247	384	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	53	52	53	52 USD	1'511.96	70'814.76	0.02	a)
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	2'556	182	284	2'454 USD	131.95	291'651.43	0.09	a)
US59156R1086	METLIFE INC	0	1'771	0	1'771 USD	74.11	118'215.80	0.04	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	4'864	67	538	4'393 USD	420.72	1'664'694.42	0.53	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	814	0	814	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	728	0	728	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0	770	770	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE INC	0	31	31	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1'751	0	0	1'751 USD	67.25	106'061.70	0.03	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	0	1'428	0	1'428 USD	70.00	90'033.97	0.03	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	856	1'018	1'874	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	191	629	0	820 USD	104.97	77'528.11	0.02	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	56	130	63	123 USD	607.33	67'283.72	0.02	a)
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	101	0	101 USD	137.92	12'546.68	0.00	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	2'391	0	2'391	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELOCK INC	0	1'314	0	1'314 USD	22.40	26'510.84	0.01	a)
US6703461052	NUCOR CORP	826	353	865	314 USD	197.90	55'970.04	0.02	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	1'835	0	250	1'585 USD	903.56	1'289'930.84	0.41	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	52	0	52	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	0	142	142	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	544	0	544	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6826801036	ONEOK INC	0	1'229	0	1'229 USD	80.17	88'745.01	0.03	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	439	0	439	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	301	301	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	902	122	629	395 USD	166.80	59'343.52	0.02	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	592	0	592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	979	0	0	979 USD	144.90	127'770.69	0.04	a)
US69370C1009	PTC INC	0	491	0	491 USD	188.94	83'557.52	0.03	a)
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	0	175	0	175 USD	189.78	29'913.60	0.01	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	312	142	454	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	431	83	514	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	310	0	0	310 USD	175.01	48'865.77	0.02	a)
US7170811035	PFIZER INC	6'218	0	6'218	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	0	799	799	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	113	0	113	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	2'190	465	1'314	1'341 USD	162.25	195'971.83	0.06	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1'272	0	0	1'272 USD	117.40	134'504.05	0.04	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	1'338	0	197	1'141 USD	120.62	123'961.02	0.04	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	1'188	524	373	1'339 USD	169.30	204'182.11	0.06	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	820	890	1'140	570 USD	133.11	68'338.54	0.02	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	187	0	0	187 USD	962.49	162'113.06	0.05	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	1'296	0	0	1'296 USD	21.04	24'560.14	0.01	a)
US7595091023	RELIANCE INC	455	0	455	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	813	0	813	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	100	0	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	1'059	0	91	968 USD	301.18	262'592.10	0.08	a)
US81762P1021	SERVICENOW INC	303	0	46	257 USD	762.40	176'480.28	0.06	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	437	0	437 USD	347.33	136'711.14	0.04	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	902	307	1'209	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	253	498	284	467 USD	125.87	52'944.31	0.02	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	417	0	77	340 USD	296.22	90'713.82	0.03	a)
US8574771031	STATE STREET CORP	1'728	0	0	1'728 USD	77.32	120'341.59	0.04	a)
US8636671013	STRYKER CORP	0	69	69	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	323	76	204	195 USD	571.50	100'376.26	0.03	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	3'163	0	0	3'163 USD	43.12	122'845.18	0.04	a)
US8718291078	SYSCO CORP	1'780	0	652	1'128 USD	81.18	82'478.04	0.03	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	606	199	407 USD	163.22	59'833.99	0.02	a)
US88160R1014	TESLA INC	1'684	132	186	1'630 USD	175.79	258'084.51	0.08	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	63	0	0	63 USD	581.21	32'980.24	0.01	a)
US88579Y1010	3M CO	1'314	0	0	1'314 USD	106.07	125'535.95	0.04	a)
US89400J1079	TRANSUNION	620	0	620	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	0	1'340	0	1'340 USD	64.36	77'678.53	0.02	a)
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	3'038	854	3'892	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	3'488	0	1'254	2'234 USD	76.99	154'916.49	0.05	a)
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	1'586	0	1'586 USD	22.67	32'384.33	0.01	a)
US9038453031	ULTA BEAUTY INC	0	202	0	202 USD	522.88	95'133.52	0.03	a)
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	767	0	767 USD	245.93	169'897.52	0.05	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	275	0	48	227 USD	721.11	147'437.36	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	704	0	350	354 USD	494.70	157'734.01	0.05	a)
US9182041080	VF CORP	5'407	925	6'332	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	363	69	247	185 USD	222.83	37'130.05	0.01	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	416	0	416	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	0	192	0	192 USD	231.69	40'067.17	0.01	a)
US92338C1036	VERALTO CORP	0	498	0	498 USD	88.66	39'768.32	0.01	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	2'567	4'628	2'049	5'146 USD	41.96	194'484.69	0.06	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	531	0	531	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	471	0	91	380 USD	418.01	143'070.61	0.05	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	677	0	677 USD	81.67	49'800.23	0.02	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	1'506	0	190	1'316 USD	279.08	330'799.44	0.10	a)
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	465	465	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	668	0	668 USD	145.68	87'650.94	0.03	a)
US9311421039	WALMART INC	518	819	518	819 USD	60.17	44'385.80	0.01	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	0	329	329	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	422	0	422 USD	317.53	120'691.69	0.04	a)
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	605	268	349	524 USD	272.75	128'728.94	0.04	a)
US98419M1009	XYLEM INC	1'063	0	1'063	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	1'106	0	1'106	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	987	0	987 USD	131.98	117'329.02	0.04	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	95	0	95	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	1'555	1'880	3'435	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	0	111	0	111 USD	192.63	19'258.70	0.01	a)
<b>USD</b>							<b>24'588'699.43</b>	<b>7.77</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>3'413'057.50</b>	<b>1.08</b>	
AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0247393	3.7500 % SGSPAA 3 3/4 09/27/24 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	900	0	900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0278554	1.5000 % TD 1 1/2 03/17/26	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
X51602259985	3.5000 % CCEP 3 1/2 04/26/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
<b>AUD</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CA13509PHQ96	1.1000 % CANHOU 1.1 03/15/31	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA639832AA25	5.2000 % NEDWBK 5.2 03/31/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	700	0	700	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA748148SA23	1.8500 % Q 1.85 02/13/27 QY	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
<b>CAD</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	1'710	0	1'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNINVX 1 5/8 11/01/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	2'330	0	2'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485261355XXX	1.5000 % *RETIRED*	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	310	0	310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0 1/8 09/18/26 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	450	0	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	620	0	620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	350	0	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>CHF</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	6'000	2'000	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X51958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	6'000	0	6'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52196300698	3.8500 % QNBK 3.85 07/10/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52451378181	2.7500 % KFW 2 3/4 03/03/25 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
<b>CNY</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002GB5	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 05/25/36 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006OB0	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CVE3	2.7500 % CADES 2 3/4 11/25/32 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTECOE0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51432493440	3.7500 % INDON 3 3/4 06/14/28 REGS	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52075937370	0.6250 % LLY 0 5/8 11/01/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52190201983	1.5000 % CROATI 1 1/2 06/17/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52286044370	0.0000 % ABBNVX 0 01/19/30 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52293075680	1.5000 % ORSTED 1 1/2 02/18/3021	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52320746394	0.9000 % VERAV 0.9 04/01/41	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52337252931	0.4500 % FDX 0.45 05/04/29	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52384726282	0.6250 % MDLZ 0 5/8 09/09/32 REGS	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>EUR</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	140	0	140	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2287624154	1.5000 % MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
<b>GBP</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
FR0014003L79	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003L79XXX	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52330256236	0.6330 % AFL 0.633 04/15/31	150'000	0	150'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52352398171	0.3000 % DNBNO 0.3 06/11/27 EMTN	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52352398171XXX	0.3000 % DNBNO 0.3 06/11/27 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52404272572	0.1100 % PG 0.11 11/06/26	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
<b>JPY</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833DN70	2.0500 % AAPL 2.05 09/11/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EL06	2.8500 % AAPL 2.85 08/05/61	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US038222AN54	1.7500 % AMAT 1 3/4 06/01/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAK17	4.0000 % HPQ 4 04/15/29	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	2'240	0	2'240	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US478160CT90	2.4500 % JNJ 2.45 09/01/60	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DE57	0.8000 % KDB 0.8 04/27/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769BR40	0.0000 % KFW 0 04/18/36	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110CA00	0.8750 % RENTEN 0 7/8 03/30/26	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBG98	2.9000 % MRK 2.9 12/10/61	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217HEP82	1.5500 % MET 1.55 01/07/31 REGS	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CF95	3.0410 % MSFT 3.041 03/17/62	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174468G77	4.4310 % MS 4.431 01/23/30 GMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63859VBF76	1.0000 % NWDI 1 08/28/25 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US717081EY56	1.7000 % PFE 1.7 05/28/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86964WAJ18	3.7500 % SUZANO 3 3/4 01/15/31	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	3'900	0	0	3'900 USD	97.16%	3'413'057.50	1.08	a)
US91324PCQ37	4.6250 % UNH 4 5/8 07/15/35	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEA66	3.1250 % UNH 3 1/8 05/15/60	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP2000TAA36	3.2500 % BANBRA 3 1/4 09/30/26 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU01386AF57	5.7500 % ALCSW 5 3/4 12/06/52 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2338980746	0.3750 % FMSWER 0 3/8 05/06/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>USD</b>							<b>3'413'057.50</b>	<b>1.08</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1328441832	PROCIMMO REAL ESTATE SIC-RTS	0	4'122	4'122	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	6'197	6'197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	2'609	2'609	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>29'800'545.11</b>	<b>9.42</b>	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INTERSWISS	6'419	0	1'000	5'419 CHF	179.00	970'001.00	0.31	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	4'556	0	0	4'556 CHF	216.00	984'096.00	0.31	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0002782263	LA FONCIERE	7'120	0	1'200	5'920 CHF	136.50	808'080.00	0.26	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	2'100	0	600	1'500 CHF	293.00	439'500.00	0.14	a)
CH0009778769	IMMOFONDS	2'607	0	500	2'107 CHF	568.00	1'196'776.00	0.38	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	11'072	0	1'500	9'572 CHF	227.00	2'172'844.00	0.69	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	23'200	0	5'000	18'200 CHF	87.80	1'597'960.00	0.51	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	9'378	0	1'500	7'878 CHF	137.00	1'079'286.00	0.34	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	43'972	0	9'000	34'972 CHF	143.50	5'018'482.00	1.59	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	23'828	0	5'000	18'828 CHF	66.00	1'242'648.00	0.39	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	3'889	0	800	3'089 CHF	221.00	682'669.00	0.22	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND	3'979	0	1'000	2'979 CHF	194.00	577'926.00	0.18	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	22'000	0	10'000	12'000 CHF	19.90	238'800.00	0.08	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	4'495	0	1'200	3'295 CHF	149.00	490'955.00	0.16	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	12'717	0	3'000	9'717 CHF	148.00	1'438'116.00	0.45	a)
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	4'122	0	0	4'122 CHF	146.00	601'812.00	0.19	a)
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	2'869	0	910	1'959 CHF	173.00	338'907.00	0.11	a)
CH0037430946	SWC (CH) REF RESPONSIBLE IFCA FA CHF	6'217	0	1'500	4'717 CHF	170.50	804'248.50	0.25	a)
CH0039415010	REALSTONE SWISS PROPERTY	4'701	0	0	4'701 CHF	129.00	606'429.00	0.19	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	10'567	0	2'000	8'567 CHF	126.00	1'079'442.00	0.34	a)
CH0111959190	SWC (CH) REF RESP SWISS COMMERCIAL FA CHF	4'045	0	0	4'045 CHF	103.50	418'657.50	0.13	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	9'498	0	1'000	8'498 CHF	149.00	1'266'202.00	0.40	a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	27'771	0	13'000	14'771 CHF	13.25	195'715.75	0.06	a)
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A	3'135	0	0	3'135 CHF	104.00	326'040.00	0.10	a)
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	7'375	0	1'200	6'175 CHF	122.50	756'437.50	0.24	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	10'093	0	1'500	8'593 CHF	159.50	1'370'583.50	0.43	a)
IE00BYLVK39	UBS ETF BLOOMBERG COMMODITY CMCI H CHF	242'253	0	0	242'253 CHF	12.79	3'097'931.36	0.98	a)
<b>CHF</b>							<b>29'800'545.11</b>	<b>9.42</b>	

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

**227'921'223.86 72.05**

#### Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

**227'921'223.86 72.05**

CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	0	76'995	0	76'995 CHF	1'393.27	107'274'545.22	33.91	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	64'219	0	0	64'219 CHF	47.25	3'034'277.11	0.96	a)
CH0388442359	SWC (CH) EF RESPONSIBLE SMC CH (II) NT CHF	31'571	919	0	32'490 CHF	124.14	4'033'246.02	1.28	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	49'311	0	0	49'311 CHF	147.44	7'270'138.03	2.30	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS. GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	0	994'316	0	994'316 CHF	86.48	85'983'796.79	27.18	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	18'519	0	0	18'519 CHF	93.41	1'729'833.46	0.55	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	18'762	0	2'595	16'167 CHF	129.48	2'093'331.44	0.66	a)

**CHF 211'419'168.07 66.84**

LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	17'035	0	0	17'035 USD	293.98	4'510'712.10	1.43	a)
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	48'163	0	0	48'163 USD	131.12	5'688'039.90	1.80	a)
LU2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPTS NT	13'000	52'779	0	65'779 USD	106.39	6'303'303.79	1.99	a)

**USD 16'502'055.79 5.22**

#### Derivative Finanzinstrumente

**73'905.80 0.02**

#### Futures

**0.00 0.00**

12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	20	0	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	-104	104	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	59	59	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	-76	76	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	18	6	24	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	-7	7	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	AUST 10Y BOND FUT DEC23	48	0	48	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US LONG BOND(CBT) DEC23	15	0	15	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	29	0	29	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	BCOM COMDTY IND DEC23	0	339	339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	6	0	6	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	CAN 10YR BOND FUT DEC23	-42	42	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
02/24	HANG SENG IDX FUT FEB24	0	18	18	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NIKKEI 225 (SGX) MAR24	0	30	30	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	251	251	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	70	70	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	64	64	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	MSCI EMGMKT MAR24	0	48	48	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NASDAQ 100 E-MINI MAR24	0	21	21	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	7	7	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	E-MINI RUSS 2000 MAR24	0	36	36	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	AUST 10Y BOND FUT MAR24	0	48	48	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US LONG BOND(CBT) MAR24	0	15	15	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR ULTRA FUT MAR24	0	29	29	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	BCOM COMDTY IND MAR24	0	339	339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	10	10	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	HANG SENG IDX FUT MAR24	0	18	18	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	CAN 10YR BOND FUT MAR24	0	42	42	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
04/24	HANG SENG IDX FUT APR24	0	18	0	18 HKD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	NIKKEI 225 (SGX) JUN24	0	26	30	-4 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	BCOM COMDTY IND JUN24	0	339	0	339 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US LONG BOND(CBT) JUN24	0	15	15	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	29	0	29 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	0	77	-77 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	0	11	-11 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	0	23	-23 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	MSCI EMGMKT JUN24	0	48	0	48 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NASDAQ 100 E-MINI JUN24	0	21	12	9 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	10	0	10 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	0	42	-42 CAD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall	02.11.2023	34'026'605	37'477'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall	02.11.2023	36'076'000	3'095'068	NOK/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	02.11.2023	157'643	267'000	CHF/AUD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	02.11.2023	7'566'920	6'799'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	02.11.2023	4'310'755	6'373'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.11.2023	17'931'910	18'581'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	02.11.2023	12'597'135	2'057'357'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	02.11.2023	8'996'548	72'182'000	CHF/CNY	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.12.2023	8'275'682	1'377'547'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.12.2023	328'750	505'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.12.2023	31'965'809	35'553'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	19'101'701	19'938'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.12.2023	6'860'598	6'267'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.12.2023	28'676	50'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	04.12.2023	8'953'722	72'881'000	CHF/CNY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	19'024'002	19'938'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.01.2024	30'994'217	35'553'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.01.2024	6'924'740	6'267'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.01.2024	28'892	50'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.01.2024	323'762	505'000	CHF/CAD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	04.01.2024	8'919'614	72'881'000	CHF/CNY	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.01.2024	11'175'662	1'877'603'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall	02.02.2024	36'686'000	3'024'431	NOK/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.02.2024	34'077'296	40'653'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	02.02.2024	11'486'676	1'929'454'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	02.02.2024	6'928'579	6'486'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.02.2024	16'205'466	17'450'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	02.02.2024	8'723'056	73'876'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	02.02.2024	108'954	172'000	CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	02.02.2024	230'834	403'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	01.03.2024	3'537'764	5'513'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	01.03.2024	20'221'000	21'693'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	01.03.2024	39'469'117	45'844'000	CHF/USD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	01.03.2024	8'765'503	73'013'000	CHF/CNY	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/NOK Verfall 01.03.2024		36'697'000	3'015'319		NOK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.03.2024		11'410'512	1'948'350'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.03.2024		7'199'441	6'594'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.03.2024		266'938	471'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.03.2024		1'000'000	1'136'685		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		40'236'545	45'844'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		11'402'192	1'948'350'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		20'630'889	21'693'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		7'323'685	6'594'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		8'899'628	73'013'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.04.2024		36'697'000	3'044'200		NOK/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		269'149	471'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		3'568'730	5'513'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 03.04.2024		799'650'000	5'428'533		JPY/USD	0.00	0.00	
	JPY/USD Verfall 03.04.2024		5'388'288	799'650'000		USD/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		40'311'000	36'291'026		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		1'610'192'000	9'587'840		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		1'621'000	1'846'308		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		2'445'000	1'442'631		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		15'558'000	15'208'692		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		65'434'000	8'132'399		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		4'705'000	3'122'544		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.05.2024		4'328'000	2'538'965		AUD/CHF	-2'844.06	0.00	b)
	CHF/NOK Verfall 02.05.2024		36'088'000	3'005'986		NOK/CHF	-18'350.69	-0.01	b)
	CAD/CHF Verfall 02.05.2024		452'112	681'000		CHF/CAD	307.70	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 02.05.2024		5'529'528	4'862'000		CHF/GBP	17'360.71	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 02.05.2024		5'358'079	5'932'000		CHF/USD	35'000.76	0.01	b)
	JPY/CHF Verfall 02.05.2024		1'999'624	333'826'000		CHF/JPY	9'953.98	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		6'348'466	6'514'000		CHF/EUR	26'903.66	0.01	b)
	CNY/CHF Verfall 06.05.2024		958'351	7'701'000		CHF/CNY	5'573.74	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>73'905.80</b>	<b>0.02</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'864'804.94	1.54
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	48'238'374.99	15.25
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'413'057.50	1.08
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	257'721'768.97	81.48
Andere Anlagen - Metallkonten	1'543'715.94	0.49
Derivative Finanzinstrumente	73'905.80	0.02
Sonstige Vermögenswerte	462'458.53	0.15
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>316'318'086.67</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-230'634.78	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>316'087'451.89</b>	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	309'373'201.46	97.80
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	73'905.80	0.02
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>	<b>2'940'582.26</b>	<b>0.93</b>

ISIN	Bezeichnung	Anz	Wäh- rung	Kurs	Kurswert CHF	in % 7)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	41	EUR	833.70	33'250.31	0.01
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	1'714	USD	152.26	235'058.96	0.07
US1491231015	CATERPILLAR INC	599	USD	366.43	197'696.06	0.06
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	98	USD	732.63	64'668.22	0.02
US4612021034	INTUIT INC	310	USD	650.00	181'491.05	0.06
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	537	USD	481.57	232'923.80	0.07
US5949181045	MICROSOFT CORP	4'393	USD	420.72	1'664'694.42	0.53
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	1'316	USD	279.08	330'799.44	0.10

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.03.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>				<b>2'887'971.73</b>	<b>0.91</b>	
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	3'300 USD	87.39%	2'887'971.73	0.91	
<b>Andere Wertpapiere</b>				<b>2'462'324.00</b>	<b>0.78</b>	
CH0002785456	SOLVALOR 61	1'500 CHF	293.00	439'500.00	0.14	
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	5'000 CHF	137.00	685'000.00	0.22	
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	12'000 CHF	19.90	238'800.00	0.08	
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	509 CHF	149.00	75'841.00	0.02	
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	6'867 CHF	149.00	1'023'183.00	0.32	

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

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

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
Bond	CHF	8'483'212.40	94.645
Equity	CHF	480'000.00	5.355
Total	CHF	8'963'212.40	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	53'503'237.14	16.927
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	36'953'848.20	11.691
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	2'940'582.26
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	2'887'971.73
Andere Wertpapiere	CHF	2'462'324.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	0.900	1.600	0.700	0.200	4.000
CT CHF	0.490	1.050	0.290	0.200	4.000

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

## 9 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.



## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).  
Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen.

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

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

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

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

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
  - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.