

Swiss Life Funds II (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

für qualifizierte Anleger

mit dem Teilvermögen

Swiss Life Funds II (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2023

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2023

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft	4	
Swiss Life Funds II (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)	6	I-A1/ CH0369737942

Verkaufsrestriktionen

Anteile von Teilvermögen dieses Umbrella-Fonds dürfen US-Personen weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

US-Person bedeutet:

- (i) ein US-amerikanischer Staatsbürger (inklusive doppelter oder mehrfacher Staatsbürgerschaft);
- (ii) eine in den USA wohnhafte Person (Resident Alien, der eine Green Card besitzt oder den «Substantial Presence Test» besteht);
- (iii) eine Personengesellschaft oder eine Gesellschaft in den USA oder unter US-Recht oder dem Recht eines US-Bundesstaates;
- (iv) einen Nachlass eines Erblassers, der US-Staatsbürger oder in den USA wohnhaft ist;
- (v) einen Trust, wenn (x) ein US-Gericht gemäss geltendem Gesetz Anordnungen oder Urteile bezüglich wesentlicher Aspekte der Trust-Verwaltung treffen kann und (y) eine oder mehrere US-Personen die Befugnis haben, die wesentlichen Entscheidungen des Trusts zu kontrollieren;
- (vi) eine Person, die dem US-amerikanischen Steuerrecht aus anderen Gründen unterliegt (u. a. doppelter Wohnsitz, Ehepartner mit gemeinsamer Einreichung, Verzicht auf US-Staatsbürgerschaft oder langfristige, dauerhafte Niederlassung in den USA).

Dieser Absatz und die hier verwendeten Begriffe sind in Übereinstimmung mit dem US Internal Revenue Code auszulegen.

Internetadresse

www.swisslife-am.com

Organisation

Fondsleitung

Swiss Life Asset Management AG
General-Guisan-Quai 40
8002 Zürich

Verwaltungsrat

Präsident

Stefan Mächler

Group CIO und Mitglied der Konzernleitung der Swiss Life-Gruppe, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrats der Ina Invest Holding AG und der Ina Invest AG

Mitglieder

Hermann Inglin

Swiss Life Investment Management Holding AG, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Lorenzo Kyburz

Swiss Life Investment Management Holding AG, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Dr. Rolf Aeberli

Head Corporate Mandates Swiss Life AG, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrates der First Swiss Mobility 2020-2 AG, der First Swiss Mobility 2022-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-1 AG sowie der RWA Consulting AG

Geschäftsleitung

Robin van Berkel

CEO, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Daniel Berner

Stellvertretender CEO, Bereichsleiter Securities

Paolo di Stefano

Bereichsleiter Real Estate, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Christoph Gisler

Bereichsleiter Infrastructure Equity, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Jan Grunow

Bereichsleiter Operations, mit einem Stiftungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Mark Fehlmann

Bereichsleiter Sales & Marketing, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Marion Koch

Bereichsleiterin Private Clients

Depotbank

UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160, 8050 Zürich

Übertragung der Fondsadministration

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel, übertragen: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Weiterdelegation

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, weiterdelegiert. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen UBS Fund Management (Switzerland) AG und Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel abgeschlossenen Vertrag geregelt.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben an die Swiss Life AG, Zürich, übertragen. Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und der Swiss Life AG abgeschlossener Vertrag.

Die interne Revision ist an das Konzernrevisorat der Swiss Life-Gruppe übertragen. Weitere Teilaufgaben im Bereich Legal & Compliance und Risk Management sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG übertragen. IT-Infrastrukturdienstleistungen, Applikationsentwicklung und -betrieb sowie IT-Risk Management und IT-Security sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG und an die Swiss Life AG übertragen. Die Beauftragten zeichnen sich aus durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen. Die genaue Ausführung der Aufträge regeln zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und den Beauftragten abgeschlossene Verträge.

Zahlstellen

UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

an den Verwaltungsrat der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG, Zürich

Kurzbericht zur Prüfung der Jahresrechnung

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Umbrella-Fonds Swiss Life Funds II (CH) mit dem Teilvermögen

Bond Global Corporates (CHF hedged)

– bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b–h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) – geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt «Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung» unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Umbrella-Fonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung einer Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Umbrella-Fonds abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers AG

Andreas Scheibli
Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Revisor

Michael Zobrist
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 16. Januar 2024

Swiss Life Funds II (CH)

Bond Global Corporates (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2023	30.9.2022	30.9.2021
Nettofondsvermögen in CHF		691 769 304.52	704 607 551.79	852 684 565.84
Klasse I-A1	CH0369737942			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		808.37	830.62	1 027.35
Anzahl Anteile im Umlauf		855 755,9740	848 294,0730	829 985,4360

Performance

	Währung	2022/2023	2021/2022	2020/2021
Klasse I-A1	CHF	-0.1%	-17.3%	0.5%
Referenzindex:				
Bloomberg Global Aggregate Corporates in CHF (CHF hedged)	CHF	0.0%	-18.5%	0.7%

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

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die Risikoprämien von Unternehmensanleihen reduzierten sich in der Berichtsperiode stark, wobei besonders der klare Rückgang der Inflationsraten die Stimmung der Investoren verbesserte. Dank der raschen Leitzinsanhebungen der letzten 18 Monate sind die Rendite am Unternehmensanleihen stark angestiegen und damit in einem Vergleich mit anderen Anlageklassen wesentlich attraktiver geworden. Nachdem das vierte Quartal 2022 noch recht volatil war, geprägt durch die Ängste über einen möglichen Engpass in der Energieversorgung in Europa, hellte sich das konjunkturelle Umfeld anfangs des Jahres klar auf. Dies führte auch zu einem klaren Rückgang der Kreditspreads im ersten Halbjahr. Wesentlich volatiler präsentierte sich dagegen das dritte Quartal 2023. Auf der einen Seite schwächte sich die Konjunktur in Europa ab, auf der anderen Seite überraschte das Wirtschaftswachstum in den USA positiv. Beunruhigt zeigten sich die Risikomärkte über die anziehenden Energiepreise, wodurch das Risiko angestiegen ist, dass die Inflationsraten noch länger erhöht bleiben könnten. Dank des positiven Umfelds lagen die Returns per Mitte Jahr klar im Plus - dies änderte sich jedoch im Q3/23. Die höheren Energiepreise und starken US-Wirtschaftsdaten führten zu einem klaren Anstieg der Staatsanleihenrenditen. Dies belastete die Performance klar und sowohl der Fund als auch der Benchmark schlossen die Periode mit einem leicht negativen Return ab. Auf Grund der im Schnitt defensiven Positionierung erzielte der Fund eine leicht tiefere Rendite als der Benchmark.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	40,99
Frankreich	8,03
Grossbritannien	6,01
Japan	5,42
Kanada	3,95
Schweiz	3,90
Niederlande	2,84
Spanien	2,72
Italien	2,12
Deutschland	2,09
Übrige	17,94
Total	96,01

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2023	30.9.2022
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	35 855 398.42 ¹	49 914 307.30
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	676 921 351.55	656 302 915.13
Derivative Finanzinstrumente	-15 107 889.85	-4 884 519.06
Sonstige Vermögenswerte	7 299 135.20	4 663 253.32
Gesamtfondsvermögen	704 967 995.32	705 995 956.69
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-13 111 139.27	-1 214 862.38
Andere Verbindlichkeiten	-87 551.53	-173 542.52
Nettofondsvermögen	691 769 304.52	704 607 551.79

Erfolgsrechnung

	1.10.2022-30.9.2023	1.10.2021-30.9.2022
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	593 256.96	55 344.79
Negativzinsen	-64 511.97	-164 340.41
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	25 190 840.25	19 244 132.89
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	232 001.68	152 560.10
Total Ertrag	25 951 586.92	19 287 697.37
Aufwand		
Passivzinsen	-10 296.99	-10 279.77
Prüfaufwand	-15 885.75	-16 962.75
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-304 614.81	-335 232.43
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-61 438.02	-59 158.61
Sonstige Aufwendungen	-3 045.26	-20 614.11
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-323 389.40	-1 754.02
Total Aufwand	-718 670.23	-444 001.69
Nettoertrag	25 232 916.69	18 843 695.68
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-29 011 412.58	-51 538 285.85
Realisierter Erfolg	-3 778 495.89	-32 694 590.17
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	3 257 125.68	-114 286 070.88
Gesamterfolg	-521 370.21	-146 980 661.05

Verwendung des Erfolges

	1.10.2022-30.9.2023	1.10.2021-30.9.2022
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	25 232 916.69	18 843 695.68
Vortrag des Vorjahres	34 529.73	22 962.47
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	25 267 446.42	18 866 658.15
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-25 244 801.23	-18 832 128.42
Vortrag auf neue Rechnung	22 645.19	34 529.73

¹ Zum 30. September 2023 wurden gegenüber Goldman Sachs in Höhe von CHF 680 000 als Sicherheiten hinterlegt.
Zum 30. September 2023 wurden gegenüber JP Morgan Chase New York in Höhe von CHF 870 000 als Sicherheiten hinterlegt.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2022-30.9.2023	1.10.2021-30.9.2022
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	704 607 551.79	852 684 565.84
Ordentliche Jahresausschüttung	-18 869 801.82	-18 545 670.92
Saldo aus dem Anteilverkehr	6 552 924.76	17 449 317.92
Gesamterfolg	-521 370.21	-146 980 661.05
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	691 769 304.52	704 607 551.79

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2022-30.9.2023	1.10.2021-30.9.2022
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	848 294,0730	829 985,4360
Ausgegebene Anteile	21 914,9010	18 448,6370
Zurückgenommene Anteile	-14 453,0000	-140,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	855 755,9740	848 294,0730
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	7 461,9010	18 308,6370

Ausschüttung für 2022/2023

Klasse I-A1

(Ex-Datum 16.1.2024)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	29.5265
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	29.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-10.3250
Netto pro Anteil (zahlbar ab 18.1.2024)	CHF	19.1750
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 18.1.2024)	CHF	29.5000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Notes, fester Zins							
EUR							
A1 TOWERS HOLDING GMBH-REG-S 5.25000% 23-13.07.28*	EUR	1 700 000	1 700 000				
ADIDAS AG-REG-S 3.12500% 22-21.11.29*	EUR	2 700 000	2 700 000				
AMPRION GMBH-REG-S 3.45000% 22-22.09.27*	EUR	2 200 000	2 200 000				
AMPRION GMBH-REG-S 3.97100% 22-22.09.32*	EUR	900 000	900 000				
ASAHI GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 0.01000% 21-19.04.24*	EUR	3 500 000	3 500 000	3 500 000	3 312 655	0,47	
BOOKING HOLDINGS INC 4.00000% 22-15.11.26*	EUR	3 900 000	3 900 000				
BOOKING HOLDINGS INC 4.75000% 22-15.11.34*	EUR	3 000 000	3 000 000				
CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 2.00000% 20-17.07.30*	EUR	2 000 000		2 000 000	1 553 288	0,22	
DELL BANK INTERNATIONAL DAC-REG-S 1.62500% 20-24.06.24*	EUR	1 000 000		1 000 000	950 045	0,13	
DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.00000% 20-15.01.32*	EUR	1 000 000		1 000 000	697 730	0,10	
GENERAL MILLS INC 3.90700% 23-13.04.29*	EUR	1 500 000	1 000 000	500 000	477 212	0,07	
GREAT-WEST LIFECO INC-REG-S 4.70000% 22-16.11.29*	EUR	3 800 000	3 800 000	3 800 000	3 732 474	0,53	
HEIDELBERGCEMENT AG-REG-S 3.75000% 23-31.05.32*	EUR	3 900 000	3 900 000				
INVESTOR AB-REG-S 2.75000% 22-10.06.32*	EUR	1 800 000		1 800 000	1 574 119	0,22	
L'OREAL SA-REG-S 0.37500% 22-29.03.24*	EUR	2 700 000		2 700 000			
LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.87500% 19-17.09.26*	EUR	2 500 000		2 500 000			
MAGNA INTERNATIONAL INC 4.37500% 23-17.03.32*	EUR	2 300 000	2 300 000				
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS 3.12500% 22-15.10.31*	EUR	3 300 000	3 300 000				
NETFLIX INC-REG-S 3.62500% 19-15.06.30*	EUR	2 200 000		2 200 000	2 020 657	0,29	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 0.80000% 19-01.08.31*	EUR	2 700 000		2 700 000	1 982 145	0,28	
REWE INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.87500% 23-13.09.30*	EUR	2 400 000	2 400 000	2 400 000	2 328 077	0,33	
SANOFI-REG-S 0.87500% 22-06.04.25*	EUR	600 000	600 000				
SANOFI-REG-S 1.25000% 22-06.04.29*	EUR	2 900 000	2 900 000				
SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.25000% 23-14.09.26*	EUR	1 300 000		1 300 000	1 259 773	0,18	
SIRIUS REAL ESTATE LTD-REG-S 1.12500% 21-22.06.26*	EUR	2 200 000		2 200 000	1 876 048	0,27	
SMITH & NEPHEW PLC 4.56500% 22-11.10.29*	EUR	1 300 000	1 300 000				
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 1.02300% 20-23.06.24*	EUR	2 200 000		2 200 000	2 077 924	0,29	
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE-REG-S 3.12500% 22-28.03.25*	EUR	2 800 000	2 800 000				
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 3.75000% 22-28.09.27*	EUR	1 900 000	1 900 000				
Total EUR					23 842 147	3,38	
GBP							
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.00000% 23-10.01.30*	GBP	3 300 000		3 300 000	3 562 160	0,51	
Total GBP					3 562 160	0,51	
JPY							
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.30000% 16-02.11.26*	JPY	180 000 000		180 000 000	1 084 763	0,15	
Total JPY					1 084 763	0,15	
USD							
ABBOTT LABORATORIES 4.90000% 16-30.11.46*	USD	2 200 000		2 200 000	1 832 217	0,26	
ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26*	USD	5 600 000	1 500 000	4 100 000	3 480 672	0,49	
ABBVIE INC 4.25000% 20-21.11.49*	USD	2 100 000		2 100 000	1 520 846	0,22	
ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48*	USD	2 300 000		2 300 000	1 838 693	0,26	
AIA GROUP LTD-REG-S 5.62500% 22-25.10.27*	USD	4 100 000	4 100 000				
AIA GROUP LTD-REG-S 4.95000% 23-04.04.33*	USD	2 700 000		2 700 000	2 342 245	0,33	
ALTRIA GROUP INC 3.40000% 21-04.02.41*	USD	2 700 000		2 700 000			
ALTRIA GROUP INC 5.95000% 19-14.02.49*	USD	1 000 000		1 000 000			
AMAZON.COM INC 4.95000% 14-05.12.44*	USD	2 150 000		1 000 000	980 527	0,14	
AMERICAN EXPRESS CO 5.85000% 22-05.11.27*	USD	2 300 000	2 300 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.75000% 23-12.01.26*	USD	1 600 000	1 600 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.60000% 23-17.04.30*	USD	6 200 000	5 600 000		520 642	0,07	
AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27*	USD	3 200 000		3 200 000	2 676 893	0,38	
AMGEN INC 4.20000% 22-22.02.52*	USD	3 300 000	3 300 000				
AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33*	USD	3 500 000		3 500 000	3 060 789	0,43	
AMGEN INC 5.50700% 23-02.03.26*	USD	3 000 000		3 000 000	2 727 835	0,39	
ANHEUSER-BUSCH COS 4.70000% 19-01.02.36*	USD	5 000 000		5 000 000	4 192 237	0,59	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD-REG-S 5.35500% 23-14.08.28*	USD	5 900 000		5 900 000	5 307 868	0,75	
AON CORP / AON GLOBAL HOLDINGS PLC 3.90000% 22-28.02.52*	USD	1 900 000		1 900 000	1 242 205	0,18	
APPLE INC 2.37500% 21-08.02.41*	USD	1 900 000		1 900 000	1 161 997	0,16	
APPLE INC 2.70000% 21-05.08.51*	USD	4 000 000		4 000 000	2 228 168	0,32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO 4.50000% 23-15.08.33*	USD	3 600 000		3 600 000	3 061 179	0,43	
AT&T INC 3.50000% 21-15.09.53*	USD	2 400 000	2 400 000				
BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 2.06100% 21-15.12.26*	USD	1 000 000		1 000 000	821 056	0,12	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 2.70400% 20-09.01.25*	USD	2 200 000		2 200 000	1 919 197	0,27	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 2.70000% 20-10.01.25*	USD	4 350 000		4 350 000	3 802 994	0,54	
BANCO SANTANDER SA 1.84900% 21-25.03.26*	USD	2 200 000		2 200 000	1 809 947	0,26	
BANCO SANTANDER SA 3.80000% 17-23.02.28*	USD	2 000 000		2 000 000	1 648 877	0,23	
BANCO SANTANDER SA 5.14700% 22-18.08.25*	USD	5 000 000		5 000 000	4 477 962	0,64	
BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27*	USD	3 750 000	2 762 000	988 000	826 900	0,12	
BAT CAPITAL CORP 4.54000% 18-15.08.47*	USD	1 000 000	1 000 000				
BAT CAPITAL CORP 7.07900% 23-02.08.43*	USD	1 600 000		1 600 000	1 403 996	0,20	
BAT CAPITAL CORP 7.08100% 23-02.08.53*	USD	1 800 000		1 800 000	1 555 511	0,22	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 1.66800% 20-25.03.26*	USD	3 200 000		3 200 000	2 637 452	0,37	
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.50000% 16-15.08.46*	USD	1 200 000		1 200 000	694 888	0,10	
BECTON DICKINSON AND CO 1.95700% 21-11.02.31*	USD	1 000 000		1 000 000	714 224	0,10	
BELL CANADA 5.10000% 23-11.05.33*	USD	8 500 000	2 500 000	6 000 000	5 131 002	0,73	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 2.85000% 20-15.05.51*	USD	4 300 000	4 300 000				
BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 3.85000% 22-15.03.52*	USD	7 000 000	5 300 000	1 700 000	1 160 011	0,16	
BLACKROCK INC 3.25000% 19-30.04.29*	USD	1 800 000		1 800 000	1 486 344	0,21	
BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.06000% 21-17.06.41*	USD	3 600 000		3 600 000	2 273 557	0,32	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.25000% 20-26.10.49*	USD	1 500 000		1 500 000	1 087 051	0,15	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.70000% 22-15.03.52*	USD	3 100 000	3 100 000				
BUNGE LTD FINANCE CORP 1.63000% 20-17.08.25*	USD	1 800 000	1 800 000				
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 4.40000% 22-05.08.52*	USD	2 600 000		2 600 000	1 975 727	0,28	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 3.85000% 22-05.08.32*	USD	2 500 000		2 500 000	2 037 068	0,29	
COLGATE-PALMOLIVE CO 3.25000% 22-15.08.32*	USD	1 200 000	1 200 000				
COLORADO INTERSTATE GAS ISSUING-144A 4.15000% 16-15.08.26*	USD	1 650 000		1 650 000	1 431 976	0,20	
COMCAST CORP 3.45000% 19-01.02.50*	USD	3 200 000		3 200 000	1 979 264	0,28	
COMCAST CORP 5.50000% 22-15.11.32*	USD	3 000 000	3 000 000	3 000 000	2 712 739	0,38	

Titel		30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 4.37500% 15-17.03.25*	USD	3 500 000			3 500 000	3 093 899	0,44	
CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24*	USD	1 800 000			1 800 000	1 600 823	0,23	
EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33*	USD	1 700 000			1 700 000	1 405 789	0,20	
EATON CORP 4.70000% 22-23.08.52*	USD	1 300 000			1 300 000	1 025 519	0,15	
EDISON INTERNATIONAL 3.55000% 19-15.11.24*	USD	1 500 000			1 500 000	1 333 416	0,19	
EDISON INTERNATIONAL 4.95000% 20-15.04.25*	USD	2 150 000			2 150 000	1 927 516	0,27	
EDP FINANCE BV-REG-S 3.62500% 17-15.07.24*	USD	2 000 000			2 000 000	1 792 328	0,25	
EDP FINANCE BV-REG-S 6.30000% 22-11.10.27*	USD		1 400 000		1 400 000	1 297 703	0,18	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-144A 6.25000% 23-23.05.33*	USD		1 400 000		1 400 000	1 282 052	0,18	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-144A 6.90000% 23-23.05.53*	USD		2 500 000		2 500 000	2 269 283	0,32	
ELEVANCE HEALTH INC 6.10000% 22-15.10.52*	USD		800 000		800 000	736 408	0,10	
ELEVANCE HEALTH INC 4.90000% 23-08.02.26*	USD		1 000 000		1 000 000	897 331	0,13	
ENBRIDGE INC 3.40000% 21-01.08.51*	USD	2 600 000			2 600 000	1 485 013	0,21	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.37500% 21-12.07.26*	USD	2 100 000			2 100 000	1 696 501	0,24	
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.85000% 13-15.03.44*	USD	1 100 000			1 100 000	864 054	0,12	
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 3.30000% 21-15.02.53*	USD	1 800 000			1 800 000	1 071 481	0,15	
ESTEE LAUDER COS INC/THE S 1.50000% 23-15.05.53*	USD		4 600 000		4 600 000	3 791 432	0,54	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES S 6.25000% 22-15.07.52*	USD	1 100 000			1 100 000	913 609	0,13	
FISERV INC 5.62500% 23-21.08.33*	USD		5 400 000		5 400 000	4 786 505	0,68	
FORTIVE CORP 4.30000% 17-15.06.46*	USD	3 000 000			3 000 000	2 062 394	0,29	
GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35*	USD	1 500 000		1 500 000				
GE HEALTHCARE HOLDINGS LLC-144A 6.37700% 22-22.11.52*	USD		1 800 000	1 800 000				
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC 6.37700% 23-22.11.52*	USD		1 800 000		1 800 000	1 673 382	0,24	
GILEAD SCIENCES INC 4.15000% 16-01.03.47*	USD	1 550 000			1 550 000	1 120 214	0,16	
GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27*	USD	2 000 000		2 000 000				
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26*	USD	4 000 000			4 000 000	3 323 186	0,47	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.85000% 19-01.11.22*	USD	2 800 000		2 800 000				
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 1.30000% 21-08.01.26*	USD	3 300 000			3 300 000	2 718 258	0,39	
INTEL CORP 5.62500% 23-10.02.43*	USD		2 500 000		2 500 000	2 180 882	0,31	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.00000% 20-15.06.50*	USD	2 100 000			2 100 000	1 183 564	0,17	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 4.60000% 22-15.03.33*	USD	1 200 000			1 200 000	1 008 396	0,14	
INTERCONTINENTAL EXCH INC 4.95000% 22-15.06.52*	USD	2 300 000			2 300 000	1 822 942	0,26	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.40000% 22-27.07.32*	USD	7 000 000			7 000 000	5 887 531	0,84	
JOHNSON & JOHNSON 2.10000% 20-01.09.40*	USD	2 300 000			2 300 000	1 346 901	0,19	
JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV-144A 6.87500% 22-24.10.32*	USD		5 100 000	3 100 000	2 000 000	1 941 341	0,28	
JUNIPER NETWORKS INC 5.95000% 11-15.03.41*	USD	1 800 000		1 800 000				
KEURIG DR PEPPER INC 4.50000% 15-15.11.45*	USD	900 000			900 000	663 577	0,09	
KEURIG DR PEPPER INC 3.95000% 22-15.04.29*	USD	1 500 000			1 500 000	1 267 477	0,18	
KEURIG DR PEPPER INC 4.50000% 22-15.04.52*	USD	2 800 000		2 800 000				
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 13-01.09.23*	USD	1 000 000			1 000 000			
KINDER MORGAN INC 2.00000% 20-15.02.31*	USD	1 900 000			1 900 000	1 327 067	0,19	
KINDER MORGAN INC 3.15000% 17-15.01.23*	USD	3 350 000			3 350 000			
KINDER MORGAN INC 5.20000% 23-01.06.33*	USD		1 000 000		1 000 000			
KOREA GAS CORP-REG-S 3.87500% 22-13.07.27*	USD	2 400 000			2 400 000			
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 4.87500% 23-03.04.28*	USD		1 700 000		1 700 000			
LOWE'S COS INC 4.05000% 17-03.05.47*	USD	2 650 000			2 650 000	1 790 028	0,25	
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29*	USD	1 700 000		1 700 000				
MARSH & MCLENNAN COS INC 2.37500% 21-15.12.31*	USD	1 000 000			1 000 000	719 289	0,10	
MASTERCARD INC 3.85000% 20-26.03.50*	USD	1 500 000			1 500 000	1 056 777	0,15	
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERIC-144A 5.25000% 22-29.11.27*	USD		2 700 000	2 700 000				
MERCK & CO INC 2.15000% 21-10.12.31*	USD	1 400 000			1 400 000	1 012 775	0,14	
MERCK & CO INC 2.75000% 21-10.12.51*	USD	4 300 000		2 000 000	2 300 000	1 270 738	0,18	
META PLATFORMS INC-144A 3.85000% 22-15.08.32*	USD	2 900 000		2 900 000				
METLIFE INC 5.00000% 22-15.07.52*	USD	800 000			800 000	631 460	0,09	
MICROSOFT CORP 2.52500% 20-01.06.50*	USD	1 250 000			1 250 000	696 271	0,10	
MICROSOFT CORP 2.92100% 21-17.03.52*	USD	2 100 000			2 100 000	1 260 053	0,18	
MITSUBISHI HC CAPITAL INC-REG-S 5.08000% 22-15.09.27*	USD	3 800 000		1 900 000	1 900 000	1 685 786	0,24	
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.66300% 17-28.02.27*	USD	3 550 000			3 550 000	3 028 123	0,43	
MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24*	USD		3 945 000		3 945 000	3 565 393	0,51	
MPLX LP 4.95000% 22-01.09.32*	USD	1 800 000		1 800 000				
MPLX LP 5.65000% 23-01.03.53*	USD		1 300 000	1 300 000				
NASDAQ INC 5.95000% 23-15.08.53*	USD		600 000		600 000	512 699	0,07	
NASDAQ INC 6.10000% 23-28.06.63*	USD		2 500 000		2 500 000	2 126 881	0,30	
NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 5.25000% 23-28.02.53*	USD		1 300 000		1 300 000	1 029 748	0,15	
NIKE INC 3.37500% 16-01.11.46*	USD	2 650 000			2 650 000	1 741 107	0,25	
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.00000% 22-15.03.32*	USD	6 600 000			6 600 000	4 974 606	0,71	
NORINCHUKIN BANK/THE REG-S 4.86700% 22-14.09.27*	USD	4 700 000		4 700 000				
NORINCHUKIN BANK/THE REG-S 5.07100% 22-14.09.32*	USD	6 000 000		6 000 000				
NORINCHUKIN BANK/THE REG-S 5.43000% 23-09.03.28*	USD	2 100 000		2 100 000				
NSTAR ELECTRIC CO 4.55000% 22-01.06.52*	USD	1 500 000			1 500 000	1 112 628	0,16	
NTT FINANCE CORP-REG-S 1.16200% 21-03.04.26*	USD	1 300 000		1 300 000				
NUTRIEN LTD 3.15000% 18-01.10.22*	USD	2 300 000		2 300 000				
NUTRIEN LTD 5.80000% 23-27.03.53*	USD		1 600 000		1 600 000	1 344 483	0,19	
NVIDIA CORP 3.50000% 20-01.04.40*	USD	1 900 000			1 900 000	1 368 461	0,19	
ONEOK INC 2.75000% 19-01.09.24*	USD	2 600 000			2 600 000	2 307 943	0,33	
ORACLE CORP 5.55000% 23-06.02.53*	USD		1 100 000	1 100 000				
OTIS WORLDWIDE CORP 5.25000% 23-16.08.28*	USD		2 600 000		2 600 000	2 337 975	0,33	
PACKAGING CORP OF AMERICA 3.40000% 17-15.12.27*	USD	1 000 000		1 000 000				
PARKER-HANNIFIN CORP 3.65000% 22-15.06.24*	USD	1 000 000		1 000 000				
PAYPAL HOLDINGS INC 5.05000% 22-01.06.52*	USD	3 400 000		1 700 000	1 700 000	1 405 772	0,20	
PEPSICO INC 3.90000% 22-18.07.32*	USD	2 300 000		2 300 000				
PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.75000% 23-19.05.33*	USD		4 500 000		4 500 000	3 909 877	0,55	
PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.30000% 23-19.05.53*	USD		3 800 000		3 800 000	3 260 484	0,46	
PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.34000% 23-19.05.63*	USD		2 500 000		2 500 000	2 089 276	0,30	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 5.62500% 22-17.11.29*	USD	1 400 000			1 400 000	1 266 193	0,18	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 5.75000% 22-17.11.32*	USD		2 500 000	2 500 000				
PHILLIPS 66 0.90000% 20-15.02.24*	USD	2 400 000			2 400 000	2 154 390	0,31	
PHILLIPS 66 3.30000% 21-15.03.52*	USD	3 600 000		2 000 000	1 600 000	919 618	0,13	
PUBLIC STORAGE 1.50000% 21-09.11.26*	USD	1 400 000		1 400 000				
QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31*	USD	5 200 000		5 200 000				
QUALCOMM INC 6.00000% 22-20.05.53*	USD		7 000 000	5 000 000	2 000 000	1 855 535	0,26	
RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 4.37500% 15-04.08.25*	USD	2 150 000			2 150 000	1 897 963	0,27	
RALPH LAUREN CORP 3.75000% 18-15.09.25*	USD	4 400 000		2 000 000	2 400 000	2 119 938	0,30	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC 2.80000% 20-15.09.50*	USD	1 600 000			1 600 000	844 800	0,12	
SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31*	USD	2 800 000		1 000 000	1 800 000	1 322 100	0,19	
SANTOS FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 23-19.09.33*	USD		1 800 000		1 800 000	1 612 755	0,23	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.00000% 16-10.05.46*	USD	2 000 000			2 000 000	1 416 340	0,20	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.00000% 21-26.11.51*	USD	7 000 000		2 600 000	4 400 000	2 513 407	0,36	

Titel		30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ-REG-S 1.20000% 21-11.03.26*	USD	1 000 000		1 000 000				
STANLEY BLACK & DECKER INC 3.00000% 22-15.05.32*	USD	2 300 000			2 300 000	1 702 000	0,24	
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-REG-S 5.65000% 23-09.03.26*	USD		2 200 000		2 200 000	1 993 576	0,28	
SWISS RE AMERICA HOLDING CORP 7.00000% 96-15.02.26*	USD	400 000		400 000				
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.02500% 20-09.07.40*	USD	2 700 000			2 700 000	1 721 051	0,24	
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.17500% 20-09.07.50*	USD	1 000 000		1 000 000				
TELEFONICA MOVILES CHILE SA-REG-S 3.53700% 21-18.11.31*	USD	3 700 000			3 700 000	2 528 416	0,36	
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.15000% 18-15.05.48*	USD	2 000 000			2 000 000	1 475 040	0,21	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.05000% 22-22.03.27*	USD	4 100 000		4 100 000				
UNITED PARCEL SERVICE INC 5.05000% 23-03.03.53*	USD		7 500 000	5 500 000	2 000 000	1 677 104	0,24	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.90000% 20-15.05.50*	USD	1 800 000		1 800 000				
VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.55000% 21-22.03.51*	USD	3 700 000			3 700 000	2 227 248	0,32	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.05000% 23-09.05.33*	USD		1 100 000		1 100 000	940 059	0,13	
VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 5.00000% 23-01.04.33*	USD		4 400 000		4 400 000	3 773 436	0,54	
VMWARE INC 1.80000% 21-15.08.28*	USD	1 300 000			1 300 000	986 962	0,14	
WALMART INC 3.90000% 23-15.04.28*	USD		1 400 000	1 400 000				
WASTE MANAGEMENT INC 2.00000% 21-01.06.29*	USD	2 300 000		2 300 000				
WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27*	USD	3 850 000			3 850 000	3 274 668	0,46	
WIPRO IT SERVICES LLC-REG-S 1.50000% 21-23.06.26*	USD	2 850 000			2 850 000	2 332 123	0,33	
WP CAREY INC 4.60000% 14-01.04.24*	USD		4 300 000		4 300 000	3 894 341	0,55	
ZOETIS INC 4.70000% 13-01.02.43*	USD	700 000			700 000	551 956	0,08	
ZOETIS INC 5.60000% 22-16.11.32*	USD		2 400 000		2 400 000	2 185 506	0,31	
Total USD						239 985 686	34,04	
Total Notes, fester Zins						268 474 756	38,08	
Notes, Nullcoupon								
EUR								
PERNOD RICARD SA-REG-S 0.00000% 19-24.10.23*	EUR		2 900 000	2 900 000				
Total EUR							0,00	
Total Notes, Nullcoupon							0,00	
Notes, variabler Zins								
EUR								
ASR NEDERLAND NV-REG-S-SUB 7.000%/VAR 22-07.12.43*	EUR		2 300 000	2 300 000				
ENI SPA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP*	EUR	3 300 000			3 300 000	2 961 649	0,42	
HANNOVER RUECK SE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 22-26.08.43*	EUR		4 400 000	4 400 000				
IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 1.874%/VAR 20-PRP*	EUR	1 600 000			1 600 000	1 400 112	0,20	
MORGAN STANLEY 4.656%/VAR 23-02.03.29*	EUR		4 700 000	2 200 000	2 500 000	2 419 105	0,34	
OMV AG-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP*	EUR	1 000 000			1 000 000	871 690	0,12	
TELIA CO AB-REG-S-SUB 4.625%/VAR 22-21.12.82*	EUR	2 400 000		2 000 000	400 000	370 672	0,05	
Total EUR						8 023 228	1,14	
GBP								
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S-SUB 8.201%/VAR 22-16.11.34*	GBP		4 500 000	4 500 000				
Total GBP							0,00	
USD								
AMERICAN EXPRESS CO 4.420%/VAR 22-03.08.33*	USD	4 700 000			4 700 000	3 836 252	0,54	
AMERICAN EXPRESS CO-SUB 4.989%/VAR 22-26.05.33*	USD	2 000 000		2 000 000				
BANCO SANTANDER SA 4.175%/VAR 22-24.03.28*	USD	1 800 000			1 800 000	1 520 471	0,22	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.247%/VAR 21-26.01.27*	USD	1 700 000			1 700 000	1 389 033	0,20	
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 0.673%/VAR 21-08.03.24*	USD	2 000 000		2 000 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.757%/VAR 22-24.01.25*	USD		3 034 000		3 034 000	2 731 522	0,39	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.482%/VAR 22-23.08.28*	USD	2 600 000		2 600 000				
HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+138BP 18-12.09.26*	USD	4 300 000			4 300 000	3 969 204	0,56	
HSBC HOLDINGS PLC-SUB 8.113%/VAR 22-03.11.33*	USD		3 600 000	3 600 000				
JP MORGAN CHASE & CO 3M SOFR +76.500BP 21-22.09.27*	USD	6 200 000			6 200 000	5 570 352	0,79	
JPMORGAN CHASE & CO 2.947%/VAR 22-24.02.28*	USD	3 000 000			3 000 000	2 489 590	0,35	
JPMORGAN CHASE & CO 5.546%/VAR 22-15.12.25*	USD		10 000 000	10 000 000				
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26*	USD	1 100 000		1 100 000				
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 4.788%/VAR 22-18.07.25*	USD	3 700 000			3 700 000	3 343 213	0,47	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.133%/VAR 22-20.07.33*	USD	4 400 000		1 500 000	2 900 000	2 493 256	0,35	
MORGAN STANLEY 5.050%/VAR 23-28.01.27*	USD		1 500 000	1 500 000				
MORGAN STANLEY-SUB 5.948%/VAR 23-19.01.38*	USD		1 500 000	1 500 000				
NATWEST GROUP PLC 5.516%/VAR 22-30.09.28*	USD	1 200 000			1 200 000	1 062 209	0,15	
PARTNERRE FINANCE B LLC-SUB 4.500%/VAR 20-01.10.50*	USD	1 100 000			1 100 000	853 463	0,12	
SANTANDER HOLDINGS USA INC 2.490%/VAR 21-06.01.28*	USD	2 800 000		2 800 000				
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 1.488%/VAR 20-14.12.26*	USD	1 000 000			1 000 000	816 702	0,12	
STATE STREET CORP 4.421%/VAR 22-13.05.33*	USD	800 000			800 000	656 551	0,09	
UBS AG/LONDON-REG-S 3M SOFR+45BP 21-09.08.24*	USD	1 600 000			1 600 000	1 461 119	0,21	
UBS GROUP AG-REG-S 1.494%/VAR 21-10.08.27*	USD	1 300 000			1 300 000	1 038 039	0,15	
UBS GROUP AG-REG-S 4.751%/VAR 22-12.05.28*	USD	1 200 000			1 200 000	1 037 223	0,15	
Total USD						34 268 198	4,86	
Total Notes, variabler Zins						42 291 427	6,00	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CHF								
ASB BANK LTD 2.50250% 23-20.12.28*	CHF		4 500 000		4 500 000	4 524 750	0,64	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 2.73250% 23-04.07.25*	CHF		4 000 000		4 000 000	4 030 000	0,57	
Total CHF						8 554 750	1,21	
EUR								
A2A SPA-REG-S 0.62500% 20-28.10.32*	EUR	1 300 000		1 300 000				
ABB FINANCE BV-REG-S 3.25000% 23-16.01.27*	EUR		1 800 000		1 800 000	1 711 417	0,24	
ABB FINANCE BV-REG-S 3.37500% 23-16.01.31*	EUR		3 700 000	3 300 000	400 000	372 317	0,05	
AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 4.87500% 23-10.07.33*	EUR		2 500 000	2 500 000				
AKZO NOBEL NV-REG-S 2.00000% 22-28.03.32*	EUR	2 000 000		2 000 000				
AROUNDTOWN SA-REG-S 1.00000% 17-07.01.25*	EUR	2 000 000			2 000 000	1 782 230	0,25	
ASSA ABLOY AB-REG-S 4.12500% 23-13.09.35*	EUR		2 800 000	2 000 000	800 000	762 460	0,11	
ASTM SPA-REG-S 1.00000% 21-25.11.26*	EUR	300 000		300 000				
AUSGRID FINANCE PTY LTD-REG-S 0.87500% 21-07.10.31*	EUR	1 300 000			1 300 000	956 519	0,14	
AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA-REG-S 4.75000% 23-24.01.31*	EUR		1 600 000	1 600 000				

Titel	30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
AXA SA-REG-S 3.75000% 22-12.10.30*	EUR	3 000 000	3 000 000				
BANQUE FEDER DU CRE MUTUEL SA-REG-S-SUB 5.12500% 23-13.01.33*	EUR	3 400 000	3 400 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 4.12500% 23-13.03.29*	EUR	2 500 000	2 500 000				
BANQUE STELLANTIS FRANCE-REG-S 3.87500% 23-19.01.26*	EUR	1 300 000	1 300 000				
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.75000% 13-25.03.25*	EUR	2 500 000		2 500 000	2 377 927	0,34	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.25000% 17-16.01.30*	EUR	3 000 000		3 000 000	2 450 379	0,35	
BAYER AG-REG-S 4.62500% 23-26.05.33*	EUR	2 800 000	2 800 000				
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 0.50000% 19-12.09.23*	EUR	4 000 000	4 000 000				
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EURO-REG-S 0.12500% 21-20.10.23*	EUR	3 100 000		3 100 000	2 994 712	0,42	
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 1.00000% 21-20.10.26*	EUR	5 000 000		5 000 000	4 198 398	0,60	
BMW FINANCE NV-REG-S 3.50000% 23-06.04.25*	EUR	5 500 000	5 500 000				
BRAMBLES FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 23-22.03.31*	EUR	2 900 000	400 000	2 500 000	2 378 996	0,34	
CAIXABANK SA-REG-S 0.62500% 19-01.10.24*	EUR	2 000 000		2 000 000	1 870 255	0,27	
CARLSBERG BREWERIES AS-REG-S 4.25000% 23-05.10.33*	EUR	3 100 000		3 100 000	2 968 716	0,42	
CARREFOUR BANQUE SA-REG-S 0.10700% 21-14.06.25*	EUR	2 200 000	2 200 000				
CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 4.25000% 22-01.12.32*	EUR	3 600 000	3 600 000				
CRH SMW FINANCE DAC-REG-S 4.25000% 23-11.07.35*	EUR	2 700 000	1 900 000	800 000	745 632	0,11	
DELL BANK INTERNATIONAL DAC-REG-S 0.50000% 21-27.10.26*	EUR	2 200 000	2 200 000				
E.ON SE-REG-S 3.87500% 23-12.01.35*	EUR	2 600 000	2 600 000				
EDP FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-11.03.30*	EUR	1 300 000	1 300 000				
EDP SERVICIOS FINANCIEROS ESPANA-REG-S 4.37500% 23-04.04.32*	EUR	3 200 000		3 200 000	3 084 881	0,44	
ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.75000% 22-12.10.34*	EUR	5 200 000	5 200 000				
ELECTROLUX AB-REG-S 2.50000% 22-18.05.30*	EUR	900 000	900 000				
ESB FINANCE DAC-REG-S 4.25000% 23-03.03.36*	EUR	2 900 000		2 900 000	2 779 961	0,39	
ESSITY CAPITAL BV-REG-S 3.00000% 22-21.09.26*	EUR	3 200 000	3 200 000				
EUROCLEAR BANK SA-REG-S 3.62500% 22-13.10.27*	EUR	2 000 000	2 000 000				
EUROGRID GMBH-REG-S 1.62500% 15-03.11.23*	EUR	4 000 000		4 000 000	3 864 531	0,55	
EUROGRID GMBH-REG-S 3.27900% 22-05.09.31*	EUR	800 000	800 000				
GSK CAPITAL BV-REG-S 3.12500% 22-28.11.32*	EUR	2 900 000	2 900 000				
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV-REG-S 0.25000% 21-13.10.24*	EUR	2 800 000		2 800 000	2 530 421	0,36	
HITACHI CAPITAL UK PLC-REG-S 0.25000% 22-03.02.25*	EUR	3 400 000		3 400 000	3 111 529	0,44	
IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S 3.37500% 22-22.11.32*	EUR	4 300 000	4 300 000				
IMPERIAL BRANDS FIN NETHERLANDS-REG-S 5.25000% 23-15.02.31*	EUR	2 500 000	700 000	1 800 000	1 692 620	0,24	
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 2.12500% 19-12.02.27*	EUR	1 600 000		1 600 000	1 442 105	0,20	
INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 5.62500% 23-08.03.33*	EUR	4 800 000	4 800 000				
KERING SA-REG-S 1.87500% 22-05.05.30*	EUR	3 900 000	3 900 000				
KERING SA-REG-S 3.25000% 23-07.02.29*	EUR	4 900 000	4 900 000				
KERING SA-REG-S 3.62500% 23-25.09.31*	EUR	4 800 000		4 800 000	4 533 504	0,64	
KERING SA-REG-S 3.87500% 23-05.09.35*	EUR	6 400 000	1 500 000	4 900 000	4 605 504	0,65	
LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-23.02.26*	EUR	2 400 000	2 400 000				
LEASYS SPA-REG-S 4.50000% 23-26.07.26*	EUR	3 600 000	1 000 000	2 600 000	2 517 606	0,36	
METSO OUTOTEC OYJ-REG-S 4.87500% 22-07.12.27*	EUR	2 000 000	2 000 000	2 000 000	1 975 381	0,28	
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-REG-S 4.60800% 23-28.08.30*	EUR	6 000 000	1 000 000	5 000 000	4 792 194	0,68	
NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC-REG-S 0.41000% 22-20.01.26*	EUR	1 700 000	1 700 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 3.25000% 22-05.09.29*	EUR	2 900 000	2 900 000				
NIBC BANK NV-REG-S 0.87500% 19-08.07.25*	EUR	1 400 000		1 400 000	1 270 135	0,18	
NIBC BANK NV-REG-S 6.37500% 23-01.12.25*	EUR	6 200 000		6 200 000	6 038 700	0,86	
NOVO NORDISK FINANCE NETHERLANDS-REG-S 0.75000% 22-31.03.25*	EUR	900 000	900 000				
NOVO NORDISK FINANCE NETHERLANDS-REG-S 1.37500% 22-31.03.30*	EUR	1 900 000	1 900 000				
NTT FINANCE CORP-REG-S 0.39900% 21-13.12.28*	EUR	2 600 000	2 600 000				
OP CORPORATE BANK PLC-REG-S 0.62500% 22-27.07.27*	EUR	1 900 000		1 900 000	1 602 835	0,23	
ORSTED AS REG-S 3.25000% 22-13.09.31*	EUR	2 700 000	2 700 000				
ORSTED AS-REG-S 2.25000% 22-14.06.28*	EUR	3 300 000	3 300 000				
ORSTED AS-REG-S 3.62500% 23-01.03.26*	EUR	3 500 000	3 500 000				
ORSTED AS-REG-S 4.12500% 23-01.03.35*	EUR	4 000 000	4 000 000				
PERNOD RICARD SA-REG-S 3.75000% 22-02.11.32*	EUR	2 800 000	2 800 000				
RCI BANQUE SA-REG-S 4.87500% 23-14.06.28*	EUR	3 400 000	3 400 000				
RCI BANQUE SA-REG-S 4.87500% 23-02.10.29*	EUR	3 400 000		3 400 000	3 270 329	0,46	
REN FINANCE B V-REG-S 0.50000% 21-16.04.29*	EUR	2 700 000	2 700 000				
RENTOKIL INITIAL FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-27.06.27*	EUR	1 500 000	1 500 000				
ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 4.37500% 23-02.06.43*	EUR	3 200 000	3 200 000				
ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 4.00000% 23-02.06.35*	EUR	3 700 000	3 700 000				
SBB TREASURY OYJ-REG-S 1.12500% 21-26.11.29*	EUR	2 700 000	2 700 000				
SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.50000% 22-09.11.32*	EUR	2 000 000	2 000 000				
SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.12500% 23-13.10.29*	EUR	3 100 000		3 100 000	2 908 120	0,41	
SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.50000% 23-12.06.33*	EUR	3 600 000		3 600 000	3 369 591	0,48	
SES SA-REG-S 3.50000% 22-14.01.29*	EUR	1 200 000	1 200 000				
SIEMENS FINANCIERIGSMATSCHAPIJ NV-REG-S 2.25000% 22-10.03.25*	EUR	2 400 000	2 400 000				
SIEMENS FINANCIERIGSMATSCHAPIJ NV-REG-S 3.00000% 22-08.09.33*	EUR	4 400 000	4 400 000				
SK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL NL-REG-S 1.75000% 22-29.03.30*	EUR	2 300 000		2 300 000	1 920 357	0,27	
STATKRAFT AS-REG-S 2.87500% 22-13.09.29*	EUR	1 000 000	1 000 000				
STELLANTIS NV-REG-S 1.25000% 21-20.06.33*	EUR	1 100 000	1 100 000				
SWEDBANK AB-REG-S 0.25000% 21-02.11.26*	EUR	3 200 000	3 200 000				
TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 1.95200% 22-08.04.30*	EUR	700 000	700 000				
TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 3.63100% 22-13.12.29*	EUR	4 000 000	4 000 000				
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 3.85000% 23-24.07.30*	EUR	4 200 000	2 800 000	1 400 000	1 335 360	0,19	
TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S 0.12500% 21-10.11.24*	EUR	1 000 000	1 000 000				
VESTAS WIND SYSTEMS A/S-REG-S 4.12500% 23-15.06.26*	EUR	2 500 000	2 500 000				
VESTEDA FINANCE BV-REG-S 0.75000% 21-18.10.31*	EUR	2 400 000	2 400 000				
VOLKSWAGEN LEASING GMBH-REG-S 0.37500% 21-20.07.26*	EUR	3 200 000	3 200 000				
VOLVO TREASURY AB-REG-S 2.00000% 22-19.08.27*	EUR	1 500 000	1 500 000				
VOLVO TREASURY AB-REG-S 3.75000% 23-25.11.24*	EUR	4 100 000		4 100 000	3 951 670	0,56	
WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.94900% 22-20.09.32*	EUR	1 200 000	1 200 000				
Total EUR					88 167 292	12,51	
GBP							
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.25000% 20-26.06.28*	GBP	1 600 000		1 600 000	1 508 555	0,21	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 5.77300% 23-25.05.38*	GBP		3 000 000	3 000 000	3 292 860	0,47	
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 2.00000% 18-04.09.23*	GBP	1 000 000	1 000 000				
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 19-11.07.24*	GBP	3 100 000		3 100 000	3 348 757	0,48	
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 1.50000% 20-23.06.23*	GBP	2 500 000	2 500 000				
MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 2.37500% 19-03.07.39*	GBP	1 000 000	1 000 000				
NATIONAL GRID ELECTRI TRANSMI PLC-REG-S 5.27200% 23-18.01.43*	GBP	3 700 000	1 700 000	2 000 000	1 997 413	0,28	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 6.37500% 22-08.11.27*	GBP	1 600 000	1 600 000				
TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 2.87500% 22-05.04.27*	GBP	1 500 000	1 500 000				
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV-REG-S 2.75000% 19-10.07.23*	GBP	2 100 000	2 100 000				
VOLVO TREASURY AB-REG-S 4.75000% 22-15.06.26*	GBP	2 400 000		2 400 000	2 626 846	0,37	
Total GBP					12 774 431	1,81	

Titel		30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
USD								
BPCE SA-REG-S 3.50000% 17-23.10.27*	USD	2 200 000			2 200 000	1 818 026	0,26	
BPCE SA-REG-S-SUB 4.50000% 14-15.03.25*	USD	2 600 000			2 600 000	2 293 983	0,33	
COLGATE-PALMOLIVE CO 3.70000% 17-01.08.47*	USD	1 100 000			1 100 000	787 030	0,11	
ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 4.50000% 19-04.12.69*	USD	1 400 000			1 400 000	815 588	0,12	
HYUNDAI MOTOR MANUFACTURING INDON-REG-S 1.75000% 21-06.05.26*	USD	2 000 000			2 000 000	1 634 857	0,23	
JT INTERNATIONAL FIN SERVICES BV-REG-S 3.87500% 18-28.09.28*	USD	4 000 000			4 000 000	3 363 220	0,48	
KOREA MINE REHABILITATION & MINER-REG-S 1.75000% 21-15.04.26*	USD	2 000 000			2 000 000	1 640 072	0,23	
QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 20-12.02.27*	USD	5 400 000		5 400 000				
QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 21-08.04.31*	USD	2 100 000			2 100 000	1 598 473	0,23	
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-REG-S 5.50000% 23-09.03.28*	USD		2 400 000	1 500 000	900 000	816 923	0,12	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.00000% 23-14.08.26*	USD		4 900 000		4 900 000	4 438 405	0,63	
UNION PACIFIC CORP 3.55000% 19-15.08.39*	USD	1 800 000			1 800 000	1 264 073	0,18	
Total USD						20 470 650	2,90	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						129 967 123	18,44	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
EUR								
ACHMEA BV-REG-S-SUB 6.750%/VAR 23-26.12.43*	EUR		2 100 000		2 100 000	2 003 150	0,28	
ALLIANZ SE-REG-S-SUB 5.824%/VAR 23-25.07.53*	EUR		3 900 000	1 500 000	2 400 000	2 340 258	0,33	
AQUARIUS + INVESTMENTS PLC-SUB 4.2500%/VAR 13-02.10.43*	EUR	2 000 000		1 595 000	405 000	391 962	0,06	
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 3M EURIBOR+100BP 21-22.09.26*	EUR	3 500 000			3 500 000	3 393 350	0,48	
BPCE SA-REG-S 4.750%/VAR 23-14.06.34*	EUR		2 900 000	600 000	2 300 000	2 188 653	0,31	
BPCE SA-REG-S-SUB 5.125%/VAR 23-25.01.35*	EUR		3 400 000	3 400 000				
DNB BANK ASA-REG-S 3.625%/VAR 23-16.02.27*	EUR		2 700 000	1 900 000	800 000	762 302	0,11	
ENEL SPA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 23-PRP*	EUR		1 800 000		1 800 000	1 760 437	0,25	
ENEL SPA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 23-PRP*	EUR		1 200 000	600 000	600 000	584 752	0,08	
ERSTE&STEIERMAERKISCHE BANKA-REG-S 0.750%/VAR 21-06.07.28*	EUR	7 000 000			7 000 000	5 525 546	0,78	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 4.787%/VAR 23-10.03.32*	EUR		5 200 000	5 200 000				
INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 5.000%/VAR 23-08.03.28*	EUR		5 400 000	4 900 000	500 000	483 042	0,07	
INVESTEK BANK PLC-REG-S 0.50000%/VAR 21-17.02.27*	EUR	3 200 000			3 200 000	2 721 805	0,39	
KBC GROEP NV-REG-S 2.875%/VAR 22-29.06.25*	EUR	3 300 000		3 300 000				
KBC GROUP NV-REG-S 4.375%/VAR 22-23.11.27*	EUR		2 100 000	2 100 000				
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 0.5000%/VAR 19-12.11.25*	EUR	1 700 000			1 700 000	1 576 384	0,22	
MBANK SA-REG-S 0.966%/VAR 21-21.09.27*	EUR	2 100 000		2 100 000				
TOTAL SE-REG-S-SUB 1.750%/VAR 19-PRP*	EUR	400 000	3 000 000		3 400 000	3 215 171	0,46	
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.708%/VAR 16-PRP*	EUR	1 350 000		1 350 000				
TOYOTA MOTOR FINANCE-REG-S 3M EURIBOR+34BP 23-31.08.25*	EUR		5 800 000		5 800 000	5 611 572	0,80	
VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 0.000%/VAR 21-27.05.24*	EUR	3 100 000		3 100 000				
Total EUR						32 558 384	4,62	
GBP								
CAIXABANK SA-REG-S 1.500%/VAR 21-03.12.26*	GBP	2 400 000			2 400 000	2 400 984	0,34	
DNB BANK ASA-REG-S 1.375%/VAR 21-02.12.25*	GBP	1 000 000			1 000 000	1 055 952	0,15	
DNB BANK ASA-REG-S 4.000%/VAR 22-17.08.27*	GBP	4 000 000			4 000 000	4 201 853	0,60	
IMPERIAL BRANDS FINAN-REG-S 8.125%/RATING LINKED 08-15.03.24*	GBP		2 000 000		2 000 000	2 250 157	0,32	
Total GBP						9 908 947	1,41	
USD								
AXA SA-REG-S-SUB 5.125%/VAR 17-17.01.47*	USD	3 550 000			3 550 000	3 092 957	0,44	
BANK OF AMERICA CORP 2.831/VAR 20-24.01.51*	USD	1 300 000		1 300 000				
ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.700%/VAR 18-22.03.28*	USD	5 000 000		5 000 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2.972%/VAR 22-16.02.28*	USD	4 800 000		2 000 000	2 800 000	2 290 844	0,32	
Total USD						5 383 801	0,76	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						47 851 132	6,79	
Anleihen, fester Zins								
EUR								
ACEF HOLDING SCA-REG-S 0.75000% 21-14.06.28*	EUR	1 400 000		1 400 000				
BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 0.33400% 21-13.08.28*	EUR	1 600 000			1 600 000	1 296 759	0,18	
BEVCO LUX SARL-REG-S 1.50000% 20-16.09.27*	EUR	1 100 000			1 100 000	957 167	0,14	
BOUYGUES SA-REG-S 4.62500% 22-07.06.32*	EUR		4 900 000	4 900 000				
DIGITAL EURO FINCO LLC-REG-S 2.62500% 16-15.04.24*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 053 193	0,43	
ESSITY AB-REG-S 0.25000% 21-08.02.31*	EUR	4 000 000		4 000 000				
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 1.00000% 21-28.05.33*	EUR	1 900 000		1 900 000				
HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.31800% 21-15.12.26*	EUR	2 200 000			2 200 000	1 894 607	0,27	
LONZA FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 23-25.05.33*	EUR		1 000 000	1 000 000				
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 3.37500% 22-15.10.34*	EUR	2 400 000		2 400 000				
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.37500% 19-09.04.24*	EUR		2 400 000		2 400 000	2 279 704	0,32	
NASDAQ INC 4.50000% 23-15.02.32*	EUR		2 900 000	1 300 000	1 600 000	1 535 941	0,22	
NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29*	EUR		2 300 000		2 300 000	2 246 142	0,32	
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 3.00000% 18-21.11.30*	EUR	1 100 000			1 100 000	982 293	0,14	
UBS GROUP AG-REG-S 2.12500% 16-04.03.24*	EUR		2 600 000		2 600 000	2 496 227	0,35	
VERALTO CORP-REG-S 4.15000% 23-19.09.31*	EUR		3 000 000		3 000 000	2 861 607	0,41	
WOLTERS KLUWER NV-REG-S 3.75000% 23-03.04.31*	EUR		1 700 000	1 700 000				
WPC EURO BOND BV 2.12500% 18-15.04.27*	EUR	2 300 000		2 100 000	200 000	177 362	0,03	
Total EUR						19 781 003	2,81	
GBP								
PEPSICO INC 3.20000% 22-22.07.29*	GBP	1 200 000		1 200 000				
PEPSICO INC 3.55000% 22-22.07.34*	GBP	1 200 000		1 200 000				
VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.50000% 19-08.04.31*	GBP	2 000 000		2 000 000				
Total GBP							0,00	
USD								
DANONE SA-144A 2.58900% 16-02.11.23*	USD	1 500 000	2 000 000		3 500 000	3 192 977	0,45	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-REG-S 4.37500% 18-21.06.28*	USD	1 750 000		1 750 000				
DUKE ENERGY INDIANA LLC 3.25000% 19-01.10.49*	USD	2 300 000			2 300 000	1 336 385	0,19	
GILEAD SCIENCES INC 3.70000% 14-01.04.24*	USD		2 434 000		2 434 000	2 202 248	0,31	
HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 1.00000% 21-26.04.24*	USD	2 700 000			2 700 000	2 399 369	0,34	
JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.25000% 15-01.10.27*	USD	1 550 000			1 550 000	1 345 455	0,19	
KOMATSU FINANCE AMERICA INC-REG-S 5.49900% 22-06.10.27*	USD		2 800 000	2 800 000				
METLIFE INC-STEP UP 14-15.12.44*	USD	2 200 000			2 200 000	1 663 669	0,24	

Titel	30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
NEXTERA ENERGY 6.05100% 23-01.03.25*	USD	1 700 000		1 700 000	1 557 513	0,22	
NOVARTIS CAPITAL CORP 4.40000% 14-06.05.44*	USD	700 000		700 000	552 759	0,08	
PACIFICORP 3.30000% 20-15.03.51*	USD	1 550 000		1 550 000	845 069	0,12	
PACIFICORP 5.50000% 23-15.05.54*	USD		2 400 000	2 400 000	1 862 052	0,26	
SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.87500% 19-01.03.49*	USD	3 850 000		3 850 000	2 877 514	0,41	
SPI AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S STEP-UP/DOWN 12-09.04.23*	USD	700 000	700 000				
Total USD					19 835 011	2,81	
Total Anleihen, fester Zins					39 616 013	5,62	
Anleihen, Nullcoupon							
EUR							
BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.00000% 21-25.06.24*	EUR	3 800 000		3 800 000	3 563 761	0,51	
Total EUR					3 563 761	0,51	
Total Anleihen, Nullcoupon					3 563 761	0,51	
Anleihen, variabler Zins							
EUR							
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP*	EUR	2 800 000		2 800 000	2 531 555	0,36	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S-SUB 2.020%/VAR 22-13.04.28*	EUR	3 100 000	1 200 000	1 900 000	1 670 749	0,24	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 4.156%/VAR 23-08.06.29*	EUR	4 400 000		4 400 000	4 188 995	0,59	
Total EUR					8 391 299	1,19	
Total Anleihen, variabler Zins					8 391 299	1,19	
Treasury-Notes, fester Zins							
USD							
AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-15.11.52*	USD	2 000 000	2 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-15.02.33*	USD	24 000 000	24 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-31.03.28*	USD	3 000 000	3 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32*	USD	8 000 000	8 000 000				
Total USD							0,00
Total Treasury-Notes, fester Zins							0,00
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					540 155 511	76,62	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

JPY							
STARBUCKS CORP 0.37200% 17-15.03.24*	JPY	250 000 000		250 000 000	1 532 405	0,22	
Total JPY					1 532 405	0,22	
USD							
7-ELEVEN INC-144A 2.50000% 21-10.02.41*	USD	2 300 000		2 300 000	1 287 081	0,18	
7-ELEVEN INC-144A 2.80000% 21-10.02.51*	USD	1 500 000	1 500 000				
AIA GROUP LTD-144A 3.37500% 20-07.04.30*	USD	1 000 000		1 000 000	800 930	0,11	
ALCON FINANCE CORP-144A 3.80000% 19-23.09.49*	USD	1 900 000		1 900 000	1 231 814	0,17	
ALCON FINANCE CORP-144A 5.75000% 22-06.12.52*	USD		1 100 000	1 100 000	956 797	0,14	
AP MOLLER - MAERSK AVS-144A 5.87500% 23-14.09.33*	USD	1 800 000		1 800 000	1 599 341	0,23	
BANQUE FEDERATIVE DU CRE MUTUEL SA-144A 4.75300% 22-13.07.27*	USD	2 400 000		2 400 000	2 102 111	0,30	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT ML SA-REG-S 4.93500% 23-26.01.26*	USD	4 700 000		4 700 000	4 184 783	0,59	
BANQUE FEDRATIVE DU CREDIT MUTEL SA-144A 5.89600% 23-13.07.26*	USD	3 500 000		3 500 000	3 184 125	0,45	
BAT CAPITAL CORP 7.75000% 22-19.10.32*	USD	1 500 000		1 500 000	1 449 437	0,21	
BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE-144A 2.50000% 19-10.01.30*	USD	4 200 000		4 200 000	3 115 546	0,44	
BLACKSTONE PRIVATE CREDIT FUND 2.62500% 22-15.12.26*	USD	4 175 000	4 175 000				
BOSTON GAS CO-144A 6.11900% 23-20.07.53*	USD	2 000 000		2 000 000	1 727 258	0,25	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.55000% 20-20.02.48*	USD	1 825 000		1 825 000	1 393 257	0,20	
CARGILL INC-144A 4.87500% 22-10.10.25*	USD	2 900 000		2 900 000			
CITADEL LP-144A 5.37500% 17-17.01.23*	USD	4 500 000		4 500 000			
COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30*	USD	1 000 000	1 000 000				
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.07900% 23-10.01.25*	USD	2 800 000		2 800 000	2 546 038	0,36	
CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 6.50000% 23-01.10.53*	USD	1 100 000		1 100 000	1 008 630	0,14	
COX COMMUNICATION INC-144A 3.35000% 16-15.09.26*	USD	1 500 000		1 500 000	1 276 899	0,18	
CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 4.75000% 22-09.08.24*	USD	2 500 000		2 500 000	2 254 498	0,32	
DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERIC-144A 5.40000% 23-20.09.28*	USD	2 300 000	2 300 000				
DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH AMERI-144A 5.20000% 23-17.01.25*	USD	1 950 000		1 950 000	1 767 340	0,25	
DAIMLER TRUCKS FINAN NORTH AME LLC-144A 5.15000% 23-16.01.26*	USD	2 600 000	2 600 000				
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 3.60000% 17-19.01.27*	USD	3 350 000		3 350 000			
EASTERN GAS TRANSMISSION & STORAGE-144A 3.90000% 21-15.11.49*	USD	1 500 000		1 500 000			
EASTERN GAS TRANSMISSION & STORAGE INC 3.90000% 22-15.11.49*	USD	1 500 000		1 500 000	896 745	0,13	
EDP FINANCE BV-144A 1.71000% 20-24.01.28*	USD	4 400 000		4 400 000	3 394 310	0,48	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 1.25000% 20-18.09.23*	USD	3 100 000	3 100 000				
ING BANK NV-144A-SUB 5.80000% 13-25.09.23*	USD	1 850 000	1 850 000				
INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.87500% 17-14.07.27*	USD	6 000 000		6 000 000	4 919 099	0,70	
INTESA SANPAOLO SPA-144A 6.62500% 23-20.06.33*	USD	1 800 000	1 800 000				
JAB HOLDINGS BV-144A 2.20000% 20-23.11.30*	USD	3 300 000		3 300 000	2 299 677	0,33	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 1.75000% 22-12.01.25*	USD	2 700 000		2 700 000	2 319 112	0,33	
KENVUE INC-144A 4.90000% 23-22.03.33*	USD	3 500 000		3 500 000	3 059 959	0,43	
KKR GROUP FINANCE CO X LLC-144A 3.25000% 21-15.12.51*	USD	1 500 000		1 500 000	803 483	0,11	
KKR GROUP FINANCE CO VI LLC-REG-S 3.75000% 19-01.07.29*	USD	2 600 000		2 600 000	2 102 394	0,30	
LEASEPLAN CORP NV-REG-S 2.87500% 19-24.10.24*	USD	2 900 000		2 900 000	2 552 176	0,36	
MARS INC-144A 4.75000% 23-20.04.33*	USD	6 700 000		6 700 000	5 801 405	0,82	
MERCEDES-BENZ FINACE NORTH AMERICA-144A 4.80000% 23-30.03.28*	USD	3 700 000	3 700 000				
META PLATFORMS INC-144A 4.45000% 22-15.08.52*	USD	4 000 000		4 000 000			
NESTLE HOLDINGS INC-144A 3.62500% 18-24.09.28*	USD	5 000 000	5 000 000				
NESTLE HOLDINGS INC-144A 4.00000% 22-12.09.25*	USD	4 100 000		4 100 000	3 666 393	0,52	
NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 2.15000% 21-01.10.31*	USD	1 600 000		1 600 000	1 091 008	0,15	
NEWCREST FINANCE PTY LTD-144A 4.20000% 20-13.05.50*	USD	1 800 000		1 800 000	1 213 047	0,17	
PARKER-HANNIFIN CORP 4.25000% 22-15.09.27*	USD	2 500 000	2 500 000				
PENSKO TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 6.05000% 23-01.08.28*	USD	2 800 000		2 800 000	2 529 309	0,36	
RABOBANK NEDERLAND NV-144A 3.87500% 18-26.09.23*	USD	2 400 000	2 400 000				

Titel	30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.31400% 22-10.03.27*	USD	5 500 000		5 500 000	4 578 758	0,65	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 3.30000% 16-15.09.46*	USD	2 900 000		2 900 000	1 834 134	0,26	
SOCIETE GENERALE SA-SUB-144A 7.36700% 23-10.01.53*	USD		6 800 000	6 800 000			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-144A 3.95000% 22-10.06.27*	USD	7 000 000		7 000 000			
UNITEDHEALTH GROUP INC 6.05000% 22-15.02.63*	USD		4 500 000	1 500 000	3 000 000	2 776 781	0,39
VIATRIS INC 1.65000% 21-22.06.25*	USD	900 000		900 000			
WESTPAC NEW ZEALAND LTD-144A 4.90200% 23-15.02.28*	USD		2 300 000	2 300 000	2 030 057	0,29	
WILLIS NORTH AMERICA INC 4.50000% 18-15.09.28*	USD	2 000 000		2 000 000	1 715 758	0,24	
YARA INTERNATIONAL ASA-REG-S 7.37800% 22-14.11.32*	USD		1 600 000	1 600 000	1 524 232	0,22	
Total USD					82 993 724	11,77	

Total Notes, fester Zins **84 526 129** **11,99**

Notes, variabler Zins

USD							
AIB GROUP PLC-144A 6.608%/VAR 23-13.09.29*	USD		2 350 000	2 350 000	2 140 840	0,30	
AIB GROUP PLC-144A 7.583%/VAR 22-14.10.26*	USD		1 700 000	1 700 000	1 583 655	0,22	
HSBC HOLDINGS PLC 6.332%/VAR 23-09.03.44*	USD		5 100 000	5 100 000			
INTESA SANPAOLO SPA-144A 8.248%/VAR 22-21.11.33*	USD		1 900 000	1 900 000			
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 5.068%/VAR 23-24.01.34*	USD		2 200 000	2 200 000			
SOCIETE GENERALE SA-REG-S O/N SOFR+105BP 22-21.01.26*	USD	7 200 000		7 200 000	6 543 734	0,93	
STATE STREET CORP 3.152%/VAR 20-30.03.31*	USD	1 900 000		1 900 000			
STATE STREET CORP 5.751%/VAR 22-04.11.26*	USD		600 000	600 000			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.418%/VAR 21-11.06.27*	USD	1 250 000		1 250 000			
US BANCORP 5.850%/VAR 22-21.10.33*	USD		4 100 000	4 100 000			
Total USD					10 268 229	1,46	

Total Notes, variabler Zins **10 268 229** **1,46**

Medium-Term Notes, fester Zins

CAD							
ALTAGAS LTD 4.40000% 14-15.03.24*	CAD	4 500 000		4 500 000	3 026 164	0,43	
Total CAD					3 026 164	0,43	

USD							
BANK OF MONTREAL 4.25000% 22-14.09.24*	USD	5 100 000		5 100 000			
BPCE SA-144A-SUB 4.87500% 16-01.04.26*	USD	1 300 000		1 300 000	1 139 938	0,16	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-144A 3.30000% 22-21.03.29*	USD	1 600 000		1 600 000			
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.05000% 22-25.08.25*	USD	4 450 000		4 450 000	3 936 217	0,56	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.55000% 23-28.01.33*	USD		2 500 000	2 500 000	2 096 619	0,30	
Total USD					7 172 774	1,02	

Total Medium-Term Notes, fester Zins **10 198 938** **1,45**

Anleihen, fester Zins

USD							
PUBLIC SERVICE CO OF COLORADO 2.70000% 20-15.01.51*	USD	2 600 000		2 600 000	1 330 435	0,19	
Total USD					1 330 435	0,19	

Total Anleihen, fester Zins **1 330 435** **0,19**

Anleihen, variabler Zins

USD							
DNB BANK ASA-REG-S 5.896%/VAR 22-09.10.26*	USD		7 500 000	7 500 000	6 837 758	0,97	
Total USD					6 837 758	0,97	

Total Anleihen, variabler Zins **6 837 758** **0,97**

Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden **113 161 489** **16,05**

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

CAD							
BANK OF NOVA SCOTIA 2.29000% 17-28.06.24**	CAD	3 500 000		3 500 000	2 313 807	0,33	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 3.00000% 19-08.02.29**	CAD	4 500 000		4 500 000	2 735 526	0,39	
Total CAD					5 049 334	0,72	

USD							
ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.51400% 22-08.03.24**	USD	6 000 000		6 000 000	5 391 534	0,76	
GLOBAL ATLANTIC FIN CO-144A 3.12500% 21-15.06.31**	USD	1 700 000		1 700 000	1 108 449	0,16	
NORTHERN NATURAL GAS CO DEL-144A 3.40000% 21-16.10.51**	USD	1 300 000		1 300 000	743 066	0,11	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD-144A 6.12500% 23-11.04.33**	USD		3 800 000	3 800 000	3 236 271	0,46	
ROYALTY PHARMA PLC 1.20000% 21-02.09.25**	USD	3 200 000		3 200 000	2 660 243	0,38	
Total USD					13 139 563	1,86	

Total Notes, fester Zins **18 188 897** **2,58**

Notes, variabler Zins

CAD							
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 2.01300%/VAR 21-28.03.29**	CAD	2 400 000		2 400 000	1 373 655	0,19	
Total CAD					1 373 655	0,19	

Total Notes, variabler Zins **1 373 655** **0,19**

Titel	30.9.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Medium-Term Notes, fester Zins							
CAD							
INTER PIPELINE LTD 2.73400% 17-18.04.24**	CAD	4 500 000		4 500 000	2 994 507	0,42	
TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.35000% 22-12.05.26**	CAD	1 600 000		1 600 000	1 047 293	0,14	
Total CAD					4 041 800	0,56	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					4 041 800	0,56	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden					23 604 352	3,34	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					676 921 352	96,01 0,00)	
Bankguthaben auf Sicht					35 855 398	5,09	
Derivative Finanzinstrumente					-15 107 890	-2,14	
Sonstige Vermögenswerte					7 299 135	1,04	
Gesamtfondsvermögen					704 967 995	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-13 111 139		
Andere Verbindlichkeiten					-87 551		
Nettofondsvermögen					691 769 305		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	652 296 320	92,53
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	9 517 142	1,34
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	661 813 462	93,87

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 07.12.23*	-50	EUR	-6 229 678	19 468	0,00
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23*	-40	USD	-4 343 013	101 772	0,01
US LONG BOND FUTURE 19.12.23*	-50	USD	-5 204 355	251 569	0,05
			-15 777 046	372 809	0,06

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23*	190	USD	18 782 559	-37 449	-0,01
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23*	115	USD	11 084 017	-90 108	-0,01
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23*	10	CAD	779 001	-22 058	0,00
			30 645 577	-149 615	-0,02

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 30 645 577

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
GS/ITRX EUROPE S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28*	55 000 000	EUR	52 804 854	-465 094	-0,07
JP MORGAN/MARKIT CDX.NA.IG.41 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28*	70 000 000	USD	63 257 220	-778 780	-0,11
			116 062 074	-1 243 874	-0,18

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
USD	192 000 000	CHF	167 888 640	09.11.2023	-6 988 964	-0,99
USD	74 000 000	CHF	63 632 156	31.10.2023	-3 856 359	-0,55
CHF	6 068 849	USD	7 000 000	31.10.2023	315 200	0,04
CAD	20 000 000	CHF	12 967 162	05.10.2023	-561 113	-0,08
USD	240 000 000	CHF	216 433 440	25.10.2023	-2 545 239	-0,36
CHF	2 732 235	USD	3 000 000	25.10.2023	4 998	0,00
EUR	190 000 000	CHF	183 378 500	30.10.2023	-313 652	-0,04

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
GBP	24 000 000	CHF	26 595 072	30.10.2023	-128 066	-0.02
JPY	424 000 000	CHF	2 602 398	30.10.2023	-1 867	0.00
CHF	1 836 972	USD	2 000 000	25.10.2023	-12 148	0.00
					-14 087 210	-2.00

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.23	EUR	145	145
EURO-BOBL FUTURE 08.06.23	EUR	120	120
EURO-BUND FUTURE 08.12.22	EUR	395	345
EURO-BOBL FUTURE 08.12.22	EUR	275	0
EURO-BUND FUTURE 08.03.23	EUR	375	375
EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	EUR	250	250
EURO-BUND FUTURE 07.09.23	EUR	45	45
EURO-BUND FUTURE 07.12.23	EUR	0	50
US LONG BOND FUTURE 20.12.22	USD	2	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.22	USD	5	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.22	USD	260	260
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.22	USD	350	195
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	USD	10	10
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	USD	240	240
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	USD	170	170
US LONG BOND FUTURE 21.06.23	USD	117	117
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	USD	45	45
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23	USD	0	40
US LONG BOND FUTURE 19.12.23	USD	0	50

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.23	EUR	125	125
EURO-BUND FUTURE 08.12.22	EUR	10	10
EURO-BUND FUTURE 08.03.23	EUR	50	50
EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	EUR	150	150
EURO-BUND FUTURE 07.09.23	EUR	5	5
LONG GILT FUTURE 28.12.22	GBP	65	65
LONG GILT FUTURE 29.03.23	GBP	65	65
US LONG BOND FUTURE 20.12.22	USD	88	88
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.22	USD	5	5
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.22	USD	230	310
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.22	USD	45	45
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	USD	7	7
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	USD	265	265
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	USD	310	310
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	USD	30	30
US LONG BOND FUTURE 22.03.23	USD	203	203
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23	USD	2	2
US LONG BOND FUTURE 21.06.23	USD	53	53
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	USD	495	495
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	USD	470	470
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.09.23	USD	305	305
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.09.23	USD	830	830
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	USD	450	260
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	115	0
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	10	0

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
GS/ITRX EUROPE S38 V1 CDI PAY 1.00000% 22-20.12.27	EUR	55 000 000
GS/ITRX EUROPE S38 V1 CDI PAY 1.00000% 22-20.12.27	EUR	55 000 000
JPM/CDX.NA.IG 39 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.27	USD	80 000 000
JPM/CDX.NA.IG 39 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.27	USD	80 000 000
GS/ITRX EUROPE S39 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.06.28	EUR	55 000 000
JPM/MARKIT CDX.NA.IG. S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.06.28	USD	100 000 000
GS/ITRX EUROPE S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28	EUR	55 000 000
JP MORGAN/MARKIT CDX.NA.IG.41 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28	USD	70 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	6 797 030	EUR	7 000 000	12.10.2022
CHF	2 005 858	USD	2 000 000	25.10.2022
CHF	2 511 538	USD	2 500 000	25.10.2022
EUR	7 000 000	CHF	6 795 658	26.10.2022
USD	10 000 000	CHF	9 894 838	26.10.2022
CHF	1 966 994	EUR	2 000 000	26.10.2022
USD	200 000 000	CHF	200 078 600	04.11.2022
USD	165 000 000	CHF	165 172 260	04.11.2022
USD	5 000 000	CHF	5 006 576	04.11.2022
USD	101 000 000	CHF	101 200 283	17.11.2022
CHF	4 021 176	USD	4 000 000	17.11.2022
CHF	92 715 085	USD	98 000 000	17.11.2022
EUR	170 000 000	CHF	167 055 345	28.11.2022

Jahresbericht per 30. September 2023

Swiss Life Funds II (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	1 000 000	CHF	989 267	28.11.2022
GBP	1 000 000	CHF	1 129 330	28.11.2022
EUR	5 000 000	CHF	4 865 562	28.11.2022
CHF	5 441 371	GBP	4 800 000	28.11.2022
EUR	6 000 000	CHF	5 924 766	28.11.2022
USD	200 000 000	CHF	198 890 800	05.12.2022
USD	176 000 000	CHF	175 221 587	05.12.2022
USD	8 000 000	CHF	7 525 643	05.12.2022
USD	3 000 000	CHF	2 855 646	05.12.2022
USD	5 000 000	CHF	4 741 625	05.12.2022
USD	3 000 000	CHF	2 830 910	05.12.2022
USD	102 000 000	CHF	96 207 094	16.12.2022
USD	200 000 000	CHF	188 392 200	19.12.2022
USD	195 000 000	CHF	182 961 090	19.12.2022
USD	7 000 000	CHF	6 564 214	19.12.2022
USD	4 000 000	CHF	3 704 480	19.12.2022
CHF	185 468 440	USD	200 000 000	19.12.2022
USD	200 000 000	CHF	185 384 940	23.12.2022
USD	200 000 000	CHF	185 689 200	27.12.2022
EUR	183 000 000	CHF	179 369 353	28.12.2022
EUR	9 500 000	CHF	9 341 015	28.12.2022
EUR	5 800 000	CHF	5 728 705	28.12.2022
CHF	986 665	EUR	1 000 000	28.12.2022
CAD	19 600 000	CHF	14 231 697	05.01.2023
CAD	600 000	CHF	414 995	05.01.2023
USD	108 000 000	CHF	99 780 012	17.01.2023
CHF	3 277 134	USD	3 500 000	17.01.2023
USD	200 000 000	CHF	184 283 000	23.01.2023
USD	200 000 000	CHF	184 940 800	27.01.2023
CHF	98 337	EUR	100 000	27.01.2023
USD	7 000 000	CHF	6 528 455	27.01.2023
USD	3 000 000	CHF	2 762 096	27.01.2023
USD	7 000 000	CHF	6 408 737	27.01.2023
GBP	19 400 000	CHF	22 028 428	30.01.2023
JPY	424 000 000	CHF	2 895 907	30.01.2023
GBP	2 400 000	CHF	2 741 143	30.01.2023
CHF	67 838	GBP	60 000	30.01.2023
CHF	335 991	GBP	300 000	30.01.2023
GBP	3 100 000	CHF	3 456 681	30.01.2023
GBP	2 100 000	CHF	2 372 834	30.01.2023
USD	98 000 000	CHF	90 486 487	17.02.2023
CHF	3 694 709	USD	4 000 000	17.02.2023
USD	205 000 000	CHF	187 317 725	23.02.2023
USD	5 000 000	CHF	4 609 830	23.02.2023
CHF	3 695 806	USD	4 000 000	23.02.2023
USD	218 000 000	CHF	200 299 381	27.02.2023
CHF	185 405 800	USD	200 000 000	27.02.2023
EUR	191 500 000	CHF	189 107 782	28.02.2023
EUR	3 000 000	CHF	3 009 773	28.02.2023
CHF	1 973 926	EUR	2 000 000	28.02.2023
CHF	1 000 996	EUR	1 000 000	08.03.2023
USD	93 000 000	CHF	85 747 302	17.03.2023
CHF	2 822 009	USD	3 000 000	17.03.2023
USD	15 000 000	CHF	13 959 186	27.03.2023
JPY	424 000 000	CHF	2 998 990	30.03.2023
GBP	27 500 000	CHF	31 137 865	30.03.2023
EUR	189 000 000	CHF	186 832 170	31.03.2023
USD	75 000 000	CHF	69 230 250	31.03.2023
CAD	20 200 000	CHF	13 704 771	05.04.2023
EUR	1 800 000	CHF	1 790 268	05.04.2023
USD	12 000 000	CHF	11 063 760	05.04.2023
USD	202 000 000	CHF	185 587 056	24.04.2023
USD	196 000 000	CHF	180 633 600	24.04.2023
USD	10 000 000	CHF	9 117 721	24.04.2023
USD	5 000 000	CHF	4 553 155	24.04.2023
USD	18 000 000	CHF	16 500 200	24.04.2023
USD	8 000 000	CHF	7 204 685	24.04.2023
CHF	2 688 078	USD	3 000 000	24.04.2023
USD	5 000 000	CHF	4 472 855	27.04.2023
USD	190 000 000	CHF	169 875 466	08.05.2023
USD	250 000 000	CHF	223 276 500	24.05.2023
USD	6 000 000	CHF	5 321 229	24.05.2023
JPY	424 000 000	CHF	2 975 647	30.05.2023
GBP	27 000 000	CHF	30 324 834	30.05.2023
USD	10 000 000	CHF	8 842 663	30.05.2023
GBP	2 000 000	CHF	2 209 161	30.05.2023
CHF	2 750 318	JPY	424 000 000	30.05.2023
EUR	184 000 000	CHF	183 003 456	31.05.2023
USD	69 000 000	CHF	62 911 323	31.05.2023
USD	5 000 000	CHF	4 445 384	31.05.2023
USD	4 000 000	CHF	3 542 062	31.05.2023
CHF	9 811 280	EUR	10 000 000	31.05.2023
CHF	1 334 165	USD	1 500 000	31.05.2023
CHF	164 988 400	EUR	170 000 000	31.05.2023
CAD	20 300 000	CHF	13 739 832	05.06.2023
USD	74 000 000	CHF	66 685 100	30.06.2023
EUR	8 500 000	CHF	8 236 029	12.07.2023
EUR	5 000 000	CHF	4 895 310	12.07.2023
CHF	292 337	EUR	300 000	12.07.2023
USD	65 000 000	CHF	57 984 160	31.07.2023
CHF	4 533 121	USD	5 100 000	31.07.2023
USD	10 000 000	CHF	8 575 584	31.07.2023
EUR	5 000 000	CHF	4 810 170	31.07.2023
EUR	2 000 000	CHF	1 912 318	31.07.2023
USD	250 000 000	CHF	221 506 750	24.08.2023
USD	5 000 000	CHF	4 366 605	24.08.2023
CHF	875 795	USD	1 000 000	24.08.2023
USD	4 000 000	CHF	3 500 679	24.08.2023
GBP	28 600 000	CHF	31 714 643	30.08.2023
JPY	420 000 000	CHF	2 735 861	30.08.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	4 541 395	GBP	4 000 000	30.08.2023
CHF	170 364	GBP	150 000	30.08.2023
CHF	6 124 283	USD	7 000 000	30.08.2023
EUR	170 000 000	CHF	164 161 520	31.08.2023
EUR	13 000 000	CHF	12 628 395	31.08.2023
EUR	8 000 000	CHF	7 624 384	31.08.2023
EUR	1 500 000	CHF	1 442 522	31.08.2023
CHF	1 916 652	EUR	2 000 000	31.08.2023
EUR	9 000 000	CHF	8 703 824	05.09.2023
CAD	20 200 000	CHF	13 460 482	05.09.2023
CHF	7 673 520	EUR	8 000 000	05.09.2023
USD	254 000 000	CHF	222 610 426	25.09.2023
CHF	1 793 304	USD	2 000 000	25.09.2023
JPY	425 000 000	CHF	2 565 972	29.09.2023
GBP	24 300 000	CHF	26 935 009	29.09.2023
EUR	192 000 000	CHF	183 054 528	29.09.2023
EUR	8 000 000	CHF	7 662 646	29.09.2023
GBP	900 000	CHF	998 708	29.09.2023
CHF	183 748 810	EUR	190 000 000	29.09.2023
CHF	26 678 928	GBP	24 000 000	29.09.2023
CHF	2 598 074	JPY	424 000 000	29.09.2023
CAD	20 000 000	CHF	12 967 162	05.10.2023
USD	240 000 000	CHF	216 433 440	25.10.2023
CHF	2 732 235	USD	3 000 000	25.10.2023
CHF	1 836 972	USD	2 000 000	25.10.2023
EUR	190 000 000	CHF	183 378 500	30.10.2023
GBP	24 000 000	CHF	26 595 072	30.10.2023
JPY	424 000 000	CHF	2 602 398	30.10.2023
USD	74 000 000	CHF	63 632 156	31.10.2023
CHF	6 068 849	USD	7 000 000	31.10.2023
USD	192 000 000	CHF	167 888 640	09.11.2023

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagementerhöhende Positionen	41 623 177,14	6,02%
Total engagementreduzierende Positionen	824 087 376,27	119,13%

Effektenleihe

Die Fondsleitung tätigt keine Effektenleihe-Geschäfte.

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse I-A1: 0,043625% p.a.;*
- Maximale Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
Klasse I-A1: 0,35% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle:
Klasse: 0,006375% p.a.;**
- Maximale Depotbankkommission für alle
Klasse gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

* bis 30.06.2023:

Klasse I-A1: 0,0425%; ab 01.07.2023: 0,043625%

** bis 30.06.2023: 0,0075%; ab 01.07.2023: 0,006375%

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1: 0,05%

Umrechnungskurse

CAD 1	=	CHF	0.676627
EUR 1	=	CHF	0.968545
GBP 1	=	CHF	1.116559
JPY 1	=	CHF	0.006130
USD 1	=	CHF	0.914800

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (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. Bewertungstag eines Teilvermögens («Bewertungstag») ist jeweils der auf einen Ausgabe- und Rücknahmetag gemäss § 17 Ziff. 1 unten folgende Bankarbeitstag. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Bewertung 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 basiert auf der jeweils relevanten Zinskurve. Die auf der Zinskurve basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze intrapoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.
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. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC-Derivate), 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.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge 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 Kommissionsätze 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 Klasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens eines Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Klasse gerundet.

(OTC-)Derivate

Führt das Teilvermögen ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so kann es dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegt das Teilvermögen dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls dem Teilvermögen ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für das Teilvermögen verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/ Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung des Teilvermögens in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was das Teilvermögen zwingen würde, seinen Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 30.9.2023	Swiss Life Funds II (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)
Währung:	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate	
Credit Agricole CIB	4 998.48
Goldman Sachs	-1 026 206.31
JP Morgan	-463 580.27
Merrill Lynch	-14 016.52
UBS AG	-6 843 315.60
Zürcher Kantonalbank	-6 988 963.50
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:	
- Anleihen	-
- Aktien	-
- Barmittel	-
- Anlagefonds	-
- Geldmarktanlagen	-
- Übrige Sicherheiten	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-