

SWISSCANTO (CH) INVESTMENT FUND I

Jahresbericht per 31.10.2024

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

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 25. Februar 2025

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF¹

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, 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 entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



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 Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds 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.

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 3. April 2023 bis 31. Oktober 2024 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF.

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, 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 Jahresrechnungen 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 den Jahresrechnungen 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 der Gesellschaft 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.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilagen

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2024, den Erfolgsrechnungen 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)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Übersicht Klassen	4
4	Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)	7
5	Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF	16
6	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF	38
7	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates	64
8	Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate	90
9	Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International	124
10	Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality	141
11	Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced	151
12	Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland	176
13	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)	185
14	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF	217
15	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	228
16	Pflichtpublikationen	230

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 Übersicht Klassen

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
NT CHF	4795679	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	32517285	CHF
BA CHF	42967257	CHF
CT CHF	37873456	CHF
DT CHF	24542672	CHF
GT CHF	32517286	CHF
NT CHF	3433555	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	32517290	CHF
BA CHF	123887465	CHF
CT CHF	37873450	CHF
DT CHF	18382812	CHF
GT CHF	32517291	CHF
MT CHF	52492050	CHF
NT CHF	2738294	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	41253666	CHF
CT CHF	41253667	CHF
NT CHF	3009873	CHF
NT USD	125531425	USD
NTH1 CHF	49241069	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	56317906	CHF
GT CHF	37165093	CHF
GTH1 CHF	55641033	CHF
MT CHF	51788899	CHF
NT CHF	3929949	CHF
NTH1 CHF	50718466	CHF
Swiss Red Cross	51196143	CHF

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	44534066	CHF
GT CHF	115184664	CHF
MT CHF	51788924	CHF
NT CHF	3433550	CHF
NTH1 CHF	110798488	CHF

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	32517289	CHF
BA CHF	113967216	CHF
CA CHF	49386803	CHF
DT CHF	18382809	CHF
GT CHF	116850022	CHF
MT CHF	51788904	CHF
NT CHF	3929951	CHF

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
DA CHF	38329217	CHF
DT CHF	30278409	CHF
FA CHF	32517292	CHF
GT CHF	36348621	CHF
NT CHF	3009874	CHF
NT USD	125531375	USD
NTH1 CHF	129351762	CHF

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	41417674	CHF
BA CHF	42967264	CHF
CT CHF	48853241	CHF
DA CHF	41417675	CHF
DT CHF	41417676	CHF
GT CHF	44360514	CHF
NT CHF	41417677	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
ASTT CHF	43450521	CHF
NTH1 CHF	55982810	CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AT CHF	132734828	CHF
BT CHF	132734848	CHF
DT CHF	132734853	CHF
NT CHF	125316359	CHF

4 Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		64'573'539.46	84'502'764.26	84'015'466.68	169'604'790.74
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		64'573'539.46	84'502'764.26	84'015'466.68	169'604'790.74
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		20'384.882	33'006.000	33'006.000	60'117.204
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		3'167.7171	2'560.2243	2'545.4604	2'821.2355
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		3'167.7171	2'560.2243	2'545.4604	2'821.2355
Thesaurierung je Anteil		52.61	49.75	45.43	41.23
Total Expense Ratio (TER)		0.01 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 NT CHF	24.48 %	10.92 %	-15.40 %	23.41 %
Benchmark	27.36 %	12.82 %	-16.87 %	25.95 %
Tracking Error ³³⁾	2.28 %	1.75 %	3.30 %	3.35 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse NT CHF	-2.88 %
---------------	---------

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'138'887.97	2'114'207.65
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	63'402'570.34	82'349'921.81
Sonstige Vermögenswerte	69'548.49	93'325.59
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	64'611'006.80	84'557'455.05
Andere Verbindlichkeiten	-37'467.34	-54'690.79
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	64'573'539.46	84'502'764.26

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse NT CHF	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		33'006.000	33'006.000
Zurückgenommene Anteile		-12'621.118	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		20'384.882	33'006.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		84'502'764.26	84'015'466.68
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-574'745.00	-524'835.47
Saldo aus dem Anteilverkehr		-38'367'987.55	0.00
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		19'013'507.75	1'012'133.05
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		64'573'539.46	84'502'764.26

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		20'947.96	37'442.19
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-502.61	-1'005.55
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'612'025.36	1'585'735.87
Erträge der Gratisaktien		1'099.57	14'898.55
Erträge aus Wertpapierleihe		4'765.85	5'147.45
Total Ertrag		1'638'336.13	1'642'218.51
Aufwand			
Passivzinsen		-156.32	-64.83
Sonstige Aufwendungen		-6'352.17	-25.10
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-559'263.48	0.00
Total Aufwand		-565'771.97	-89.93
Nettoertrag / Verlust		1'072'564.16	1'642'128.58
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		9'672'723.01	-2'100'588.14
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		27'248.99	0.00
Realisierter Erfolg		10'772'536.16	-458'459.56
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		8'240'971.59	1'470'592.61
Gesamterfolg		19'013'507.75	1'012'133.05

Verwendung des Erfolges

Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	1'072'564.16	1'642'128.58
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'072'564.16	1'642'128.58
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	375'397.46	574'745.00
Thesaurierung; Nettobetrag zur Wiederanlage	697'166.70	1'067'383.58
Total	1'072'564.16	1'642'128.58

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							63'402'570.34	98.13	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							63'402'570.34	98.13	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	99'255	2'174	41'185	60'244 AUD	17.92	611'446.64	0.95	a)
AU							611'446.64	0.95	
BMG3223R1088	EVEREST GROUP LTD	2'731	35	1'797	969 USD	355.61	297'963.59	0.46	a)
BM							297'963.59	0.46	
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	9'223	7'131	6'641	9'713 CAD	71.69	431'946.77	0.67	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	17'835	7'242	10'593 CAD	73.87	485'406.22	0.75	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	7'988	175	3'315	4'848 CAD	150.35	452'151.84	0.70	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	13'836	0	13'836	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	28'048	362	18'386	10'024 CAD	44.83	278'758.46	0.43	a)
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	0	72'497	21'598	50'899 CAD	18.41	581'274.54	0.90	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	48'701	734	49'435	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	30'575	30'575	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14'169	310	5'879	8'600 CAD	50.57	269'779.95	0.42	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	20'449	448	8'485	12'412 CAD	52.56	404'683.40	0.63	a)
CA							2'904'001.18	4.49	
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	0	14'599	5'928	8'671 EUR	25.03	203'702.91	0.32	a)
CH							203'702.91	0.32	
KYG070341048	BAIDU INC-CLASS A	26'368	600	10'950	16'018 HKD	89.20	158'917.50	0.25	a)
CN							158'917.50	0.25	
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8'004	82	5'823	2'263 EUR	72.32	153'637.39	0.24	a)
DE0005552004	DHL GROUP	10'906	0	10'906	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	7'511	164	3'117	4'558 EUR	55.70	238'332.61	0.37	a)
DE0007164600	SAP SE	4'173	91	1'732	2'532 EUR	214.80	510'566.06	0.79	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	3'493	77	1'449	2'121 EUR	178.40	355'213.51	0.55	a)
DE							1'257'749.57	1.95	
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	0	19'879	19'879	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES							0.00	0.00	
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	0	4'745	1'927	2'818 EUR	96.90	256'341.39	0.40	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	9'356	205	9'561	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120578	SANOFI	4'783	0	4'783	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	2'736	0	2'736 EUR	228.85	587'788.35	0.91	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	5'778	127	2'398	3'507 EUR	237.20	780'916.16	1.21	a)
FR0010411983	SCOR SE	7'813	10'455	18'268	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR							1'625'045.90	2.52	
GB0002374006	DIAGEO PLC	15'044	9'603	6'242	18'405 GBP	2'399.00	490'856.20	0.76	a)
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	0	43'764	0	43'764 GBP	644.60	313'614.06	0.49	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	11'992	263	4'976	7'279 GBP	5'016.00	405'898.51	0.63	a)
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	26'559	582	11'020	16'121 GBP	961.00	172'227.93	0.27	a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	0	231'451	93'980	137'471 GBP	292.50	447'018.18	0.69	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	20'030	371	10'120	10'281 GBP	4'730.00	540'610.80	0.84	a)
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8'814	0	8'814	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	134'393	2'943	55'765	81'571 GBP	367.70	333'439.95	0.52	a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	22'026	15'271	15'144	22'153 GBP	1'392.50	342'938.29	0.53	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	30'893	677	12'819	18'751 GBP	2'578.50	537'501.63	0.83	a)
IE00BDVJJQ56	NVENT ELECTRIC PLC	0	11'131	6'768	4'363 USD	74.57	281'329.20	0.44	a)
IE00B783TY65	APTIV PLC	4'139	91	1'717	2'513 USD	56.83	123'491.08	0.19	a)
GB							3'988'925.83	6.17	
HK0941009539	CHINA MOBILE LTD	77'500	0	32'000	45'500 HKD	71.45	361'586.51	0.56	a)
HK							361'586.51	0.56	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	3'411	29	2'632	808 USD	344.82	240'918.01	0.37	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	6'482	2'632	3'850 USD	89.25	297'121.73	0.46	a)
IE							538'039.74	0.83	
IT0003128367	ENEL SPA	150'540	3'297	62'465	91'372 EUR	6.97	597'860.51	0.93	a)
IT							597'860.51	0.93	
JP3200450009	ORIX CORP	42'700	900	17'700	25'900 JPY	3'270.00	480'775.06	0.74	a)
JP3201200007	OLYMPUS CORP	43'400	22'800	26'900	39'300 JPY	2'710.50	604'695.00	0.94	a)
JP3205800000	KAO CORP	15'400	5'100	13'300	7'200 JPY	6'780.00	277'112.81	0.43	a)
JP3294460005	INPEX CORP	59'218	1'300	24'600	35'918 JPY	2'013.50	410'542.57	0.64	a)
JP3435000009	SONY GROUP CORP	11'400	35'300	11'700	35'000 JPY	2'723.50	541'115.33	0.84	a)
JP3595200001	TOSOH CORP	27'200	600	11'300	16'500 JPY	1'910.00	178'900.57	0.28	a)
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	16'900	40'800	25'300	32'400 JPY	3'273.00	601'984.67	0.93	a)
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	41'600	900	17'300	25'200 JPY	2'387.50	341'537.45	0.53	a)
JP							3'436'663.46	5.32	
NL0006294274	EURONEXT NV	5'231	115	2'171	3'175 EUR	101.40	302'228.66	0.47	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	1'410	22	835	597 EUR	621.20	348'144.66	0.54	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	12'025	4'883	7'142 EUR	45.19	302'981.53	0.47	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	26'851	588	11'141	16'298 EUR	15.67	239'810.46	0.37	a)
NL							1'193'165.31	1.85	
SE0000667891	SANDVIK AB	24'519	12'100	14'869	21'750 SEK	209.00	367'354.38	0.57	a)
SE							367'354.38	0.57	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	100'300	2'200	41'600	60'900 SGD	15.19	604'663.16	0.94	a)
SG							604'663.16	0.94	
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	4'154	67	2'375	1'846 USD	331.58	529'280.00	0.82	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	4'397	96	1'824	2'669 USD	86.85	200'439.75	0.31	a)
US0010551028	AFLAC INC	11'093	123	7'817	3'399 USD	104.79	307'989.89	0.48	a)
US00206R1023	AT&T INC	32'644	715	13'545	19'814 USD	22.54	386'181.56	0.60	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	4'135	91	1'716	2'510 USD	203.87	442'478.84	0.68	a)
US00724F1012	ADOBE INC	2'017	25	1'347	695 USD	478.08	287'310.06	0.44	a)
US0126531013	ALBEMARLE CORP	0	5'255	2'134	3'121 USD	94.73	255'650.57	0.40	a)
US0152711091	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4'036	3'461	2'890	4'607 USD	111.55	444'378.71	0.69	a)
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	17'096	344	7'895	9'545 USD	172.69	1'425'307.54	2.21	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	13'354	215	7'615	5'954 USD	171.11	880'946.80	1.36	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	19'674	431	8'163	11'942 USD	186.40	1'924'812.52	2.98	a)
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	1'263	561	1'033	791 USD	405.76	277'530.79	0.43	a)
US0378331005	APPLE INC	25'714	563	10'670	15'607 USD	225.91	3'048'739.69	4.72	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	4'083	89	1'694	2'478 USD	181.58	389'076.30	0.60	a)
US0476491081	ATKORE INC	3'676	0	3'676	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	20'422	12'393	13'324	19'491 USD	41.82	704'828.75	1.09	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	0	18'373	7'460	10'913 USD	75.36	711'132.46	1.10	a)
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	2'354	52	977	1'429 USD	233.59	288'636.96	0.45	a)
US09247X1019	BLACKROCK INC	877	19	896	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09290D1019	BLACKROCK INC	0	532	0	532 USD	981.03	451'293.81	0.70	a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	326	5	184	147 USD	4'676.25	594'402.35	0.92	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	12'895	282	5'351	7'826 USD	55.77	377'403.52	0.58	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	1'177	15'147	8'958	7'366 USD	169.77	1'081'329.68	1.67	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	18'261	5'439	13'712	9'988 USD	72.72	628'055.27	0.97	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	10'976	167	6'524	4'619 USD	62.26	248'669.51	0.38	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	4'059	89	1'684	2'464 USD	148.82	317'078.99	0.49	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	4'821	0	4'821	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	20'679	453	8'580	12'552 USD	65.31	708'856.09	1.10	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	4'577	3'091	3'114	4'554 USD	96.20	378'820.57	0.59	a)
US2681501092	DYNATRACE INC	0	14'527	5'899	8'628 USD	53.80	401'381.98	0.62	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	14'793	275	7'438	7'630 USD	116.78	770'474.85	1.19	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	4'171	91	1'731	2'531 USD	567.58	1'242'180.44	1.92	a)
US3364331070	FIRST SOLAR INC	0	4'658	1'891	2'767 USD	194.48	465'317.69	0.72	a)
US34959E1091	FORTINET INC	0	8'697	3'532	5'165 USD	78.66	351'309.36	0.54	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	20'353	8'460	18'846	9'967 USD	88.82	765'492.05	1.18	a)
US42809H1077	HESS CORP	3'384	74	1'404	2'054 USD	134.48	238'849.09	0.37	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	2'160	47	896	1'311 USD	393.75	446'363.54	0.69	a)
US4581401001	INTEL CORP	7'309	0	7'309	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	6'041	132	2'507	3'666 USD	206.72	655'300.37	1.01	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	9'118	200	3'783	5'535 USD	221.92	1'062'134.53	1.64	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	4'126	90	1'712	2'504 USD	159.86	346'130.28	0.54	a)
US4932671088	KEYCORP	22'625	22'563	18'349	26'839 USD	17.25	400'332.54	0.62	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	7'672	168	3'183	4'657 USD	134.18	540'330.50	0.84	a)
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	13'614	298	5'649	8'263 USD	51.85	370'469.08	0.57	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	0	1'166	473	693 USD	829.74	497'210.99	0.77	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	4'243	93	1'761	2'575 USD	261.83	582'991.33	0.90	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	2'038	45	846	1'237 USD	499.59	534'378.40	0.83	a)
US57667L1070	MATCH GROUP INC	8'921	0	8'921	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5801351017	MCDONALD'S CORP	3'735	82	1'550	2'267 USD	292.11	572'615.90	0.89	a)
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	8'540	187	3'544	5'183 USD	102.32	458'571.65	0.71	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	13'388	287	5'731	7'944 USD	406.35	2'791'289.99	4.32	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	2'505	5'087	7'592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6153691059	MOODY'S CORP	1'958	0	1'958	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	7'262	8'768	6'509	9'521 USD	26.76	220'309.96	0.34	a)
US6516391066	NEWMONT CORP	7'234	158	3'002	4'390 USD	45.44	172'491.74	0.27	a)
US65339F1012	NEXTERA ENERGY INC	5'354	117	2'222	3'249 USD	79.25	222'645.77	0.34	a)
US6541061031	NIKE INC -CL B	2'944	64	1'222	1'786 USD	77.13	119'116.04	0.18	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	4'551	48'572	23'435	29'688 USD	132.76	3'408'110.32	5.27	a)
US6907421019	OWENS CORNING	6'022	132	2'499	3'655 USD	176.79	558'740.99	0.86	a)
US7134481081	PEPSICO INC	6'882	52	5'482	1'452 USD	166.08	208'520.81	0.32	a)
US7170811035	PFIZER INC	26'894	216	21'121	5'989 USD	28.30	146'556.88	0.23	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	10'833	197	5'581	5'449 USD	165.18	778'286.91	1.20	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	5'750	1'211	3'893	3'068 USD	162.77	431'812.47	0.67	a)
US7588491032	REGENCY CENTERS CORP	9'435	1'303	3'915	6'823 USD	71.44	421'485.15	0.65	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	0	669	194	475 USD	838.20	344'275.98	0.53	a)
US7593516047	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	0	2'094	0	2'094 USD	211.08	382'198.71	0.59	a)
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	2'550	36	1'987	599 USD	480.36	248'805.01	0.39	a)
US83088M1027	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5'322	117	2'208	3'231 USD	87.58	244'685.01	0.38	a)
US8666741041	SUN COMMUNITIES INC	0	4'523	1'607	2'916 USD	132.68	334'548.00	0.52	a)
US8716071076	SYNOPSIS INC	1'818	470	929	1'359 USD	513.61	603'557.13	0.93	a)
US88160R1014	TESLA INC	2'578	56	1'070	1'564 USD	249.85	337'894.84	0.52	a)
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	3'139	0	3'139	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2'014	44	836	1'222 USD	546.32	577'276.35	0.89	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	1'016	22	422	616 USD	812.80	432'942.15	0.67	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	1'282	737	820	1'199 USD	564.50	585'259.66	0.91	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	26'413	578	10'960	16'031 USD	42.13	584'006.30	0.90	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2'556	1'392	2'231	1'717 USD	475.98	706'682.70	1.09	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	3'937	62	2'280	1'719 USD	289.85	430'838.63	0.67	a)
US9311421039	WALMART INC	6'035	18'502	13'547	10'990 USD	81.95	778'775.19	1.21	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	5'575	94	3'056	2'613 USD	215.85	487'704.68	0.75	a)
US9581021055	WESTERN DIGITAL CORP	9'986	219	4'144	6'061 USD	65.31	342'286.23	0.53	a)
US98980L1017	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	0	5'600	0	5'600 USD	74.74	361'915.00	0.56	a)

US

45'255'484.15 70.04

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	910	0	0	910 USD	0.00%	0.00	0.00	c)
--------------	--------------------------------	-----	---	---	---------	-------	------	------	----

VC

0.00 0.00

Bezugsrechte

0.00 0.00

GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	30'893	30'893	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	30'893	30'893	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9Z14	SHELL PLC - EEE JUN24	0	30'893	30'893	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1WB003	SHELL PLC - EEE SEPT24	0	30'893	30'893	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001578	UNILEVER PLC-DRIP	0	20'030	20'030	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001YU5	UNILEVER PLC	0	16'939	16'939	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001ZB2	NN GROUP NV-SCRIP	0	11'767	11'767	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023K6	UNILEVER PLC	0	16'939	16'939	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL00150026R4	UNILEVER PLC	0	16'939	16'939	0 GBP	0.00	0.00	0.00	

Diverse

0.00 0.00

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'138'887.97	1.76
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	63'402'570.34	98.13
Sonstige Vermögenswerte	69'548.49	0.11
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	64'611'006.80	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-37'467.34	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	64'573'539.46	

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);	63'402'570.34	98.13
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
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	2'459'487.47	3.81
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	2'459'487.47	3.81
US02079K3059 ALPHABET INC-CL A	5'954 USD 171.11	880'946.80 1.36
US11135F1012 BROADCOM INC	7'366 USD 169.77	1'081'329.68 1.67
US5324571083 ELI LILLY & CO	693 USD 829.74	497'210.99 0.77

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
HKD	100 = CHF	11.12240200
JPY	100 = CHF	0.56766800
NOK	100 = CHF	7.83924400
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
USD	1 = CHF	0.86470000

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
Equity	CHF	3'296'800.00	100.000

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	2'459'487.47
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

MSCI® World ex Switzerland Index TR Net

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.

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	Ja	CHF	52.615	18.415	34.200

Sonderausschüttung 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Sonderausschüttung der ausländischen Quellensteuer

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	CHF	0.9500	0.3325	0.6175

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

5 Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'057'316'289.85	3'596'400'249.72	2'131'455'556.11	1'745'881'904.78
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'219'931.92	11'337'269.13	4'826'328.12	3'416'901.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		149'219.915	126'810.422	55'485.112	35'052.404
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.2951	89.4033	86.9842	97.4798
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.5810	89.1619	87.2626	97.4018
Ausschüttung je Anteil		0.35	0.15	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'632'197.29	5'753'943.43	3'044'523.12	3'994'462.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		107'383.833	61'917.705	33'706.366	39'588.963
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.0112	92.9289	90.3249	100.8984
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.3082	92.6780	90.6139	100.8177
Ausschüttung je Anteil		0.65	0.50	0.20	-
Total Expense Ratio (TER)		0.53 %	0.53 %	0.53 %	0.53 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		36'796'863.55	30'922'435.08	25'351'514.92	23'296'438.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		372'763.517	335'021.005	283'185.260	232'944.513
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.7137	92.3000	89.5227	100.0085
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.0098	92.0508	89.8092	99.9285
Thesaurierung je Anteil		0.71	0.50	0.12	0.12
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		197'559'492.60	191'667'885.81	144'122'027.50	127'993'786.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'910'470.603	1'983'477.076	1'538'589.351	1'223'850.038
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.4088	96.6323	93.6715	104.5829
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.7190	96.3714	93.9713	104.4992
Thesaurierung je Anteil		0.83	0.61	0.21	0.23
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'217'822'726.61	2'136'619'465.64	1'475'121'714.79	1'132'914'429.11
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		22'311'918.591	23'005'430.022	16'387'031.175	11'273'849.216
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.4008	92.8746	90.0176	100.4905
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.6990	92.6238	90.3057	100.4101
Thesaurierung je Anteil		0.82	0.61	0.22	0.24
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'580'285'077.88	1'220'099'250.63	478'989'447.66	454'265'887.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'261'150.786	1'044'762.292	424'188.090	361'248.054
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'253.0501	1'167.8247	1'129.1912	1'257.4902
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'256.8092	1'164.6716	1'132.8046	1'256.4842
Thesaurierung je Anteil		14.98	12.04	7.41	7.87
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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	7.38 %	7.42 %	-12.35 %	-2.51 %
Klasse BA CHF	7.72 %	7.76 %	-12.07 %	-2.19 %
Klasse CT CHF	7.76 %	7.80 %	-12.04 %	-2.15 %
Klasse DT CHF	7.25 %	7.26 %	-11.68 %	-2.07 %
Klasse GT CHF	7.27 %	7.28 %	-11.66 %	-2.05 %
Klasse NT CHF	7.68 %	7.68 %	-11.32 %	-1.67 %
Benchmark	7.16 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	0.20 %	0.39 %	0.60 %	0.27 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse AA CHF	0.22 %
Klasse BA CHF	0.56 %
Klasse CT CHF	0.60 %
Klasse DT CHF	0.09 %
Klasse GT CHF	0.11 %
Klasse NT CHF	0.52 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	2'400'000.00	59'751'597.78
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'029'599'203.00	3'513'839'028.18
Derivative Finanzinstrumente	-2'588'511.38	-891'101.55
Sonstige Vermögenswerte	29'729'600.16	24'499'529.17
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'059'140'291.78	3'597'199'053.58
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'013'209.32	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-810'792.61	-798'803.86
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'057'316'289.85	3'596'400'249.72

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		126'810.422	55'485.112
Ausgegebene Anteile		56'508.046	99'102.470
Zurückgenommene Anteile		-34'098.553	-27'777.160
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		149'219.915	126'810.422
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		61'917.705	33'706.366
Ausgegebene Anteile		65'171.791	37'402.986
Zurückgenommene Anteile		-19'705.663	-9'191.647
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		107'383.833	61'917.705
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		335'021.005	283'185.260
Ausgegebene Anteile		112'640.775	103'601.240
Zurückgenommene Anteile		-74'898.263	-51'765.495
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		372'763.517	335'021.005
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'983'477.076	1'538'589.351
Ausgegebene Anteile		384'249.171	2'005'436.716
Zurückgenommene Anteile		-457'255.644	-1'560'548.991
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'910'470.603	1'983'477.076
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		23'005'430.022	16'387'031.175
Ausgegebene Anteile		5'227'150.843	10'917'813.238
Zurückgenommene Anteile		-5'920'662.274	-4'299'414.391
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		22'311'918.591	23'005'430.022
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'044'762.292	424'188.090
Ausgegebene Anteile		187'681.804	622'357.474
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		118'184.926	40'156.147
Zurückgenommene Anteile		-89'478.236	-41'939.419
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'261'150.786	1'044'762.292

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	13.12.2023	2'638'580.02	2'191.926
Klasse NT CHF	13.12.2023	6'690'213.09	5'557.706
Klasse NT CHF	10.10.2024	137'091'414.31	110'435.294

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'596'400'249.72	2'131'455'556.11
Ausbezahlte Ausschüttung		-51'992.24	-9'288.97
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-9'675'845.61	-4'168'786.54
Saldo aus dem Anteilverkehr		199'734'598.13	1'367'474'013.54
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		270'909'279.85	101'648'755.58
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'057'316'289.85	3'596'400'249.72

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		125'275.12	85'368.90
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		46'291'651.29	33'586'578.60
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'821'502.05	4'151'380.39
Total Ertrag		51'238'428.46	37'823'327.89
Aufwand			
Passivzinsen		-170.95	0.00
Reglementarische Vergütungen		-9'323'914.64	-8'427'938.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'619'398.05	-1'284'242.32
Total Aufwand		-11'943'483.64	-9'712'180.33
Nettoertrag / Verlust		39'294'944.82	28'111'147.56
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-261'757.21	-42'872'023.66
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		2'425'489.73	4'523'637.87
Realisierter Erfolg		41'458'677.34	-10'237'238.23
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		229'450'602.51	111'885'993.81
Gesamterfolg		270'909'279.85	101'648'755.58

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF			
Nettoertrag		54'253.71	23'395.44
Vortrag des Vorjahres		5'293.43	919.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		59'547.14	24'314.99
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		52'226.97	19'021.56
Vortrag auf neue Rechnung		7'320.17	5'293.43
Total		59'547.14	24'314.99
Klasse BA CHF			
Nettoertrag		72'969.51	30'185.56
Vortrag des Vorjahres		133.98	907.27
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		73'103.49	31'092.83
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		69'799.49	30'958.85
Vortrag auf neue Rechnung		3'304.00	133.98
Total		73'103.49	31'092.83
Klasse CT CHF			
Nettoertrag		266'164.88	170'249.88
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		266'164.88	170'249.88
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		93'157.71	59'587.46
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		173'007.17	110'662.42
Total		266'164.88	170'249.88
Klasse DT CHF			
Nettoertrag		1'600'827.91	1'224'906.83
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		1'600'827.91	1'224'906.83
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		560'289.77	428'717.39
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1'040'538.14	796'189.44
Total		1'600'827.91	1'224'906.83
Klasse GT CHF			
Nettoertrag		18'399'479.57	14'074'706.79
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		18'399'479.57	14'074'706.79
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		6'439'817.85	4'926'147.38
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		11'959'661.72	9'148'559.41
Total		18'399'479.57	14'074'706.79
Klasse NT CHF			
Nettoertrag		18'901'249.24	12'587'703.06
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		18'901'249.24	12'587'703.06
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		6'615'437.23	4'405'696.07
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		12'285'812.01	8'182'006.99
Total		18'901'249.24	12'587'703.06

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							4'029'599'203.00	99.27	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							4'029'599'203.00	99.27	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'300	0	350	1'950 CHF	97.70%	1'905'150.00	0.05	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	500	6'500 CHF	98.20%	6'383'000.00	0.16	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	100.01%	5'000'500.00	0.12	a)
AE							13'288'650.00	0.33	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'240	0	0	1'240 CHF	127.80%	1'584'720.00	0.04	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	8'700	1'530	0	10'230 CHF	100.06%	10'236'138.00	0.25	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	93.95%	2'348'750.00	0.06	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	105.55%	3'694'250.00	0.09	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	3'000	0	0	3'000 CHF	101.53%	3'045'900.00	0.08	a)
AT							20'909'758.00	0.52	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	395	395	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	99.36%	4'968'000.00	0.12	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	5'250	0	5'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.88%	998'800.00	0.02	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'500	300	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'500	640	0	2'140 CHF	98.85%	2'115'390.00	0.05	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	3'500	5'250	8'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	6'140	0	6'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	5'000	0	0	5'000 CHF	106.60%	5'330'000.00	0.13	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1357852792	0.9600 % TCV 0.96 09/04/34 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.45%	10'145'000.00	0.25	a)
AU							23'557'190.00	0.58	
CH1384254939	1.7075 % COMQAT 1.7075 10/08/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.65%	5'032'500.00	0.12	a)
BM							5'032'500.00	0.12	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	97.65%	2'929'500.00	0.07	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	500	1'000	500	1'000 CHF	99.58%	995'800.00	0.02	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	2'500	0	0	2'500 CHF	93.35%	2'333'750.00	0.06	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	11'000	205	0	11'205 CHF	96.25%	10'784'812.50	0.27	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	11'000	0	0	11'000 CHF	96.60%	10'626'000.00	0.26	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	4'500	0	4'500 CHF	98.60%	4'437'000.00	0.11	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	3'200	1'800	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	7'500	0	0	7'500 CHF	99.60%	7'470'000.00	0.18	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	103.50%	10'350'000.00	0.25	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	8'000	0	7'000	1'000 CHF	104.50%	1'045'000.00	0.03	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.95%	5'247'500.00	0.13	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	5'500	0	0	5'500 CHF	103.75%	5'706'250.00	0.14	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	10'000	0	700	9'300 CHF	104.50%	9'718'500.00	0.24	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	20'000	0	0	20'000 CHF	104.45%	20'890'000.00	0.51	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.80%	2'036'000.00	0.05	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	107.05%	6'423'000.00	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	3'000	0	2'000	1'000 CHF	109.60%	1'096'000.00	0.03	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	14'500	0	600	13'900 CHF	104.05%	14'462'950.00	0.36	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	5'000	0	1'750	3'250 CHF	102.10%	3'318'250.00	0.08	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	5'000	1'750	0	6'750 CHF	105.50%	7'121'250.00	0.18	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.95%	5'197'500.00	0.13	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	102.95%	7'206'500.00	0.18	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.12	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	103.30%	6'198'000.00	0.15	a)
CH1331113626	1.3150 % SCDA 1.315 05/02/34	0	2'000	0	2'000 CHF	104.35%	2'087'000.00	0.05	a)
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.10%	5'205'000.00	0.13	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	3'000	0	3'000 CHF	105.30%	3'159'000.00	0.08	a)
CH1353257905	2.0000 % BNS 2 08/02/30 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	105.15%	8'412'000.00	0.21	a)
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	3'500	0	3'500 CHF	101.30%	3'545'500.00	0.09	a)
CA							173'062'062.50	4.26	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	650	0	0	650 CHF	180.65%	1'174'225.00	0.03	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	0	5'500	3'000	2'500 CHF	125.59%	3'139'750.00	0.08	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	5'000	0	1'000	4'000 CHF	100.50%	4'020'000.00	0.10	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	0	2'000	0	2'000 CHF	102.33%	2'046'600.00	0.05	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	2'000	4'500	0	6'500 CHF	123.02%	7'996'300.00	0.20	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	23'000	0	23'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'215	0	0	1'215 CHF	100.67%	1'223'140.50	0.03	a)
CH0109497690	2.7500 % WINCTY 2 3/4 01/28/30	0	2'000	0	2'000 CHF	110.55%	2'211'000.00	0.05	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	2'000	0	0	2'000 CHF	105.85%	2'117'000.00	0.05	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	0	3'000	0	3'000 CHF	110.35%	3'310'500.00	0.08	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	0	1'500	0	1'500 CHF	100.97%	1'514'550.00	0.04	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	10'000	5'400	0	15'400 CHF	106.81%	16'448'740.00	0.41	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	48'000	0	13'000	35'000 CHF	105.43%	36'900'500.00	0.91	a)
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	0	7'720	7'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	4'400	0	0	4'400 CHF	110.97%	4'882'680.00	0.12	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	25'000	0	0	25'000 CHF	112.27%	28'067'500.00	0.69	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	1'500	2'000	0	3'500 CHF	116.81%	4'088'350.00	0.10	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	2'475	0	0	2'475 CHF	110.01%	2'722'747.50	0.07	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	0	10'500	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	0	4'250	0	4'250 CHF	110.15%	4'681'375.00	0.12	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	2'000	3'200	4'140	1'060 CHF	100.00%	1'060'000.00	0.03	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	240	0	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	7'000	0	4'000	3'000 CHF	100.02%	3'000'600.00	0.07	a)
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.85%	1'028'500.00	0.03	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	7'800	3'000	3'500	7'300 CHF	105.60%	7'708'800.00	0.19	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	6'200	0	6'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	700	0	0	700 CHF	101.90%	713'300.00	0.02	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	4'000	500	0	4'500 CHF	103.12%	4'640'400.00	0.11	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	0	1'895	0	1'895 CHF	101.75%	1'928'162.50	0.05	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMNIX 1 3/4 07/10/24	7'090	0	7'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	0	4'000	3'500	500 CHF	104.97%	524'850.00	0.01	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'000	1'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	0	6'000	0	6'000 CHF	103.20%	6'192'000.00	0.15	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	6'500	0	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	0	470	470	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	1'000	2'500	1'000	2'500 CHF	101.88%	2'547'000.00	0.06	a)
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	0	3'000	0	3'000 CHF	100.12%	3'003'600.00	0.07	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	18'700	1'300	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	7'000	0	2'300	4'700 CHF	112.85%	5'303'950.00	0.13	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	0	2'000	0	2'000 CHF	102.65%	2'053'000.00	0.05	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	8'000	0	2'800	5'200 CHF	108.20%	5'626'400.00	0.14	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	750	3'000	2'250	1'500 CHF	104.35%	1'565'250.00	0.04	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'135	0	2'135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	0	4'000	0	4'000 CHF	104.20%	4'168'000.00	0.10	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	10'000	0	5'000	5'000 CHF	104.35%	5'217'500.00	0.13	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	1'400	0	0	1'400 CHF	115.50%	1'617'000.00	0.04	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	8'000	0	0	8'000 CHF	162.25%	12'980'000.00	0.32	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	8'550	1'500	0	10'050 CHF	103.35%	10'386'675.00	0.26	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'000	1'700	0	5'700 CHF	100.05%	5'702'850.00	0.14	a)
CH0228531437	2.3750 % KWILLI 2 3/8 12/10/26	0	3'000	0	3'000 CHF	102.60%	3'078'000.00	0.08	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 0 5/8 06/17/26 445	3'250	0	1'300	1'950 CHF	101.41%	1'977'495.00	0.05	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	12'475	0	12'475	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	12'000	0	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	8'470	7'720	750 CHF	100.01%	750'075.00	0.02	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	2'000	2'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'050	1'000	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	2'000	0	0	2'000 CHF	101.20%	2'024'000.00	0.05	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247776138	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 07/14/26	1'500	0	0	1'500 CHF	101.25%	1'518'750.00	0.04	a)
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	105.80%	1'058'000.00	0.03	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	14'000	0	14'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252703050	1.2500 % KWILLI 1 1/4 09/11/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	20'000	0	14'000	6'000 CHF	105.85%	6'351'000.00	0.16	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'575	0	1'575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	0	2'000	0	2'000 CHF	102.05%	2'041'000.00	0.05	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	5'000	3'500	0	8'500 CHF	103.76%	8'819'600.00	0.22	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	1'740	0	1'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	0	1'300	0	1'300 CHF	100.07%	1'300'910.00	0.03	a)
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	0	700	0	700 CHF	99.99%	699'930.00	0.02	a)
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	550	0	0	550 CHF	105.50%	580'250.00	0.01	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	1'800	0	0	1'800 CHF	102.44%	1'843'920.00	0.05	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	8'350	0	8'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	3'000	0	0	3'000 CHF	99.97%	2'999'100.00	0.07	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	2'425	0	0	2'425 CHF	100.05%	2'426'212.50	0.06	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	7'000	0	0	7'000 CHF	99.93%	6'995'100.00	0.17	a)
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	32'700	0	6'700	26'000 CHF	100.84%	26'218'400.00	0.65	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	1'500	500	1'000 CHF	99.91%	999'100.00	0.02	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	5'000	0	0	5'000 CHF	99.05%	4'952'500.00	0.12	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	1'325	0	1'325	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	4'715	0	0	4'715 CHF	98.97%	4'666'435.50	0.11	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMNVX 1 04/17/35	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	5'400	0	5'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	0	4'000	0	4'000 CHF	102.10%	4'084'000.00	0.10	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	1'000	2'450	0	3'450 CHF	100.02%	3'450'690.00	0.09	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	2'000	0	2'000 CHF	99.84%	1'996'800.00	0.05	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	2'100	0	0	2'100 CHF	99.60%	2'091'600.00	0.05	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	0	2'500	0	2'500 CHF	98.22%	2'455'500.00	0.06	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	640	640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279270343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	2'500	950	0	3'450 CHF	99.61%	3'436'545.00	0.08	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	0	550	0	550 CHF	98.54%	541'970.00	0.01	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	1'000	0	0	1'000 CHF	99.78%	997'800.00	0.02	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	3'000	0	3'000 CHF	99.90%	2'997'000.00	0.07	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	6'500	1'000	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	1'000	0	0	1'000 CHF	99.15%	991'500.00	0.02	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	17'955	0	0	17'955 CHF	100.21%	17'992'705.50	0.44	a)
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	2'500	2'100	0	4'600 CHF	99.98%	4'599'080.00	0.11	a)
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	0	10'000	0	10'000 CHF	98.67%	9'867'000.00	0.24	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	4'500	420	0	4'920 CHF	98.60%	4'851'120.00	0.12	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	1'500	5'440	6'940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	0	9'700	0	9'700 CHF	98.85%	9'588'450.00	0.24	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	2'500	2'420	0	4'920 CHF	98.05%	4'824'060.00	0.12	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'500	0	0	2'500 CHF	98.32%	2'458'000.00	0.06	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	16'000	5'000	0	21'000 CHF	96.00%	20'160'000.00	0.50	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	5'000	1'565	6'565	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'400	0	0	1'400 CHF	95.30%	1'334'200.00	0.03	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMNXX 0 3/8 03/31/28	0	2'070	570	1'500 CHF	98.35%	1'475'250.00	0.04	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	3'250	3'500	4'000	2'750 CHF	98.67%	2'713'425.00	0.07	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	9'300	0	2'000	7'300 CHF	96.46%	7'041'580.00	0.17	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	2'000	2'000	0	4'000 CHF	95.10%	3'804'000.00	0.09	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	0	275	275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	0	3'500	0	3'500 CHF	91.10%	3'188'500.00	0.08	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	3'000	0	0	3'000 CHF	91.25%	2'737'500.00	0.07	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	3'000	0	0	3'000 CHF	97.75%	2'932'500.00	0.07	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	2'000	0	0	2'000 CHF	95.55%	1'911'000.00	0.05	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	2'500	0	0	2'500 CHF	89.10%	2'227'500.00	0.05	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	15'750	0	0	15'750 CHF	87.07%	13'713'525.00	0.34	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	4'000	0	0	4'000 CHF	98.34%	3'933'600.00	0.10	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	2'500	0	0	2'500 CHF	95.02%	2'375'500.00	0.06	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	3'500	0	0	3'500 CHF	98.69%	3'454'150.00	0.09	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	5'000	2'000	3'000	4'000 CHF	94.17%	3'766'800.00	0.09	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	7'000	3'000	0	10'000 CHF	89.10%	8'910'000.00	0.22	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	3'145	0	0	3'145 CHF	92.05%	2'894'972.50	0.07	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	4'100	0	500	3'600 CHF	98.35%	3'540'600.00	0.09	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	4'750	0	4'750 CHF	99.69%	4'735'275.00	0.12	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	17'500	6'000	7'500	16'000 CHF	99.92%	15'987'200.00	0.39	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	5'000	2'000	0	7'000 CHF	101.75%	7'122'500.00	0.18	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	10'500	2'000	0	12'500 CHF	100.14%	12'517'500.00	0.31	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'450	500	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	0	640	0	640 CHF	95.65%	612'160.00	0.02	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	2'500	1'305	0	3'805 CHF	99.40%	3'782'170.00	0.09	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	750	3'600	750	3'600 CHF	99.94%	3'597'840.00	0.09	a)
CH0357483160	2.0000 % KWLILI 2 12/11/23	2'000	2'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	1'500	3'000	3'220	1'280 CHF	99.25%	1'270'400.00	0.03	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	0	1'000	0	1'000 CHF	98.48%	984'800.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	15'050	10'380	25'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26		1'300	0	1'300 CHF	99.60%	1'294'800.00	0.03	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	4'000	2'500	0	6'500 CHF	98.69%	6'414'850.00	0.16	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	3'945	980	4'925	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	4'000	0	0	4'000 CHF	98.20%	3'928'000.00	0.10	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206742	0.7000 % LONNVX 0.7 07/12/24	0	970	970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	0	4'000	3'000	1'000 CHF	99.03%	990'300.00	0.02	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	5'900	0	500	5'400 CHF	98.54%	5'321'160.00	0.13	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 11/24/33	2'800	0	0	2'800 CHF	97.90%	2'741'200.00	0.07	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'000	0	0	3'000 CHF	98.40%	2'952'000.00	0.07	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	9'900	0	0	9'900 CHF	99.68%	9'868'320.00	0.24	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	4'600	0	1'000	3'600 CHF	98.88%	3'559'680.00	0.09	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	5'000	0	0	5'000 CHF	100.45%	5'022'500.00	0.12	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	3'000	0	0	3'000 CHF	95.60%	2'868'000.00	0.07	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	2'500	1'000	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	12'000	4'250	1'000	15'250 CHF	98.90%	15'082'250.00	0.37	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	7'600	0	4'250	3'350 CHF	98.50%	3'299'750.00	0.08	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	0	4'300	0	4'300 CHF	100.39%	4'316'770.00	0.11	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	4'795	0	4'795 CHF	99.93%	4'791'643.50	0.12	a)
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	0	1'000	0	1'000 CHF	99.67%	996'700.00	0.02	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	2'200	0	0	2'200 CHF	98.80%	2'173'600.00	0.05	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	2'000	0	0	2'000 CHF	97.70%	1'954'000.00	0.05	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	8'000	0	0	8'000 CHF	98.87%	7'909'600.00	0.19	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'900	0	0	1'900 CHF	99.68%	1'893'920.00	0.05	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'500	1'000	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	0	3'000	0	3'000 CHF	98.55%	2'956'500.00	0.07	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	980	0	0	980 CHF	99.60%	976'080.00	0.02	a)
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	7'000	0	0	7'000 CHF	99.33%	6'953'100.00	0.17	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	9'670	0	9'670 CHF	99.69%	9'640'023.00	0.24	a)
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	3'200	0	0	3'200 CHF	98.35%	3'147'200.00	0.08	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	10'000	0	0	10'000 CHF	100.25%	10'025'000.00	0.25	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	5'000	0	0	5'000 CHF	98.16%	4'908'000.00	0.12	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'000	0	0	1'000 CHF	99.15%	991'500.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	17'700	3'000	0	20'700 CHF	97.81%	20'246'670.00	0.50	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNVX 0 1/2 03/15/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	2'500	2'000	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'900	0	0	3'900 CHF	97.15%	3'788'850.00	0.09	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	0	640	0	640 CHF	96.55%	617'920.00	0.02	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	5'000	0	0	5'000 CHF	92.40%	4'620'000.00	0.11	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	3'370	0	0	3'370 CHF	90.10%	3'036'370.00	0.07	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	0	710	0	710 CHF	87.85%	623'735.00	0.02	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	3'000	0	0	3'000 CHF	98.77%	2'963'100.00	0.07	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	10'500	0	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	8'000	1'500	0	9'500 CHF	99.50%	9'452'500.00	0.23	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	0	1'000	0	1'000 CHF	99.40%	994'000.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	3'000	0	0	3'000 CHF	102.80%	3'084'000.00	0.08	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	10'000	20'000	0	30'000 CHF	96.08%	28'824'000.00	0.71	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	15'750	5'000	0	20'750 CHF	93.09%	19'316'175.00	0.48	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	57'500	0	0	57'500 CHF	113.75%	65'406'250.00	1.61	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	3'000	0	0	3'000 CHF	100.75%	3'022'500.00	0.07	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	2'000	0	0	2'000 CHF	92.80%	1'856'000.00	0.05	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	5'220	1'000	0	6'220 CHF	99.46%	6'186'412.00	0.15	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	19'500	275	0	19'775 CHF	94.45%	18'677'487.50	0.46	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	0	2'000	0	2'000 CHF	96.90%	1'938'000.00	0.05	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'000	0	3'000	3'000 CHF	96.99%	2'909'700.00	0.07	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	0	1'000	0	1'000 CHF	99.55%	995'500.00	0.02	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	0	1'240	0	1'240 CHF	99.63%	1'235'412.00	0.03	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	1'500	280	0	1'780 CHF	96.07%	1'710'046.00	0.04	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	11'200	5'400	2'500	14'100 CHF	94.06%	13'262'460.00	0.33	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	5'000	0	0	5'000 CHF	90.85%	4'542'500.00	0.11	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	12'000	0	0	12'000 CHF	77.80%	9'336'000.00	0.23	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	5'000	0	0	5'000 CHF	93.30%	4'665'000.00	0.11	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'000	0	0	1'000 CHF	75.40%	754'000.00	0.02	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'000	0	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.02	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	4'595	0	0	4'595 CHF	97.80%	4'493'910.00	0.11	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	20'800	0	0	20'800 CHF	95.25%	19'812'000.00	0.49	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	500	6'000	500	6'000 CHF	95.20%	5'712'000.00	0.14	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'250	3'070	0	4'320 CHF	96.90%	4'186'080.00	0.10	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	5'400	0	1'500	3'900 CHF	91.00%	3'549'000.00	0.09	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	10'000	0	0	10'000 CHF	93.35%	9'335'000.00	0.23	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.31%	2'979'300.00	0.07	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	15'000	0	0	15'000 CHF	94.90%	14'235'000.00	0.35	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	7'000	0	15'000 CHF	98.60%	14'790'000.00	0.36	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	17'500	0	0	17'500 CHF	110.45%	19'328'750.00	0.48	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	4'000	0	0	4'000 CHF	97.50%	3'900'000.00	0.10	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	18'300	0	0	18'300 CHF	80.63%	14'755'290.00	0.36	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	6'000	0	0	6'000 CHF	86.59%	5'195'400.00	0.13	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	3'000	0	0	3'000 CHF	87.00%	2'610'000.00	0.06	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	5'700	0	5'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'400	0	0	2'400 CHF	92.20%	2'212'800.00	0.05	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	12'000	0	7'000	5'000 CHF	97.23%	4'861'500.00	0.12	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	4'900	0	0	4'900 CHF	90.40%	4'429'600.00	0.11	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	100.02%	3'000'600.00	0.07	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	5'500	0	0	5'500 CHF	99.59%	5'477'450.00	0.13	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	99.20%	4'960'000.00	0.12	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	4'000	600	600	4'000 CHF	97.80%	3'912'000.00	0.10	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	500	0	0	500 CHF	89.40%	447'000.00	0.01	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	5'000	2'000	0	7'000 CHF	99.80%	6'986'000.00	0.17	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	24'000	0	10'000	14'000 CHF	96.03%	13'444'200.00	0.33	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	7'000	0	0	7'000 CHF	98.04%	6'862'800.00	0.17	a)
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	0	1'500	0	1'500 CHF	99.35%	1'490'250.00	0.04	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	1'500	0	0	1'500 CHF	87.05%	1'305'750.00	0.03	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	6'500	0	0	6'500 CHF	94.30%	6'129'500.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	3'000	0	0	3'000 CHF	92.80%	2'784'000.00	0.07	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	21'250	0	0	21'250 CHF	95.70%	20'336'250.00	0.50	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	4'000	0	0	4'000 CHF	86.90%	3'476'000.00	0.09	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	0	2'000	0	2'000 CHF	99.47%	1'989'400.00	0.05	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	5'800	0	0	5'800 CHF	93.01%	5'394'580.00	0.13	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	14'800	0	0	14'800 CHF	96.00%	14'208'000.00	0.35	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	7'000	0	2'500	4'500 CHF	92.25%	4'151'250.00	0.10	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	14'750	0	0	14'750 CHF	96.65%	14'255'875.00	0.35	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	11'700	0	0	11'700 CHF	89.74%	10'499'580.00	0.26	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	0	2'000	0	2'000 CHF	94.79%	1'895'800.00	0.05	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	92.00%	4'600'000.00	0.11	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	3'000	0	0	3'000 CHF	84.01%	2'520'300.00	0.06	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	4'200	0	0	4'200 CHF	92.00%	3'864'000.00	0.10	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	9'400	1'500	0	10'900 CHF	95.43%	10'401'870.00	0.26	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	5'000	280	0	5'280 CHF	94.70%	5'000'160.00	0.12	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	10'000	5'480	5'480	10'000 CHF	97.46%	9'746'000.00	0.24	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	2'500	0	0	2'500 CHF	93.70%	2'342'500.00	0.06	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	4'000	0	0	4'000 CHF	95.80%	3'832'000.00	0.09	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	460	460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	13'100	0	13'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	4'500	0	0	4'500 CHF	92.26%	4'151'700.00	0.10	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'875	0	0	1'875 CHF	98.50%	1'846'875.00	0.05	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNIX 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	94.40%	3'776'000.00	0.09	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	0	800	0	800 CHF	93.90%	751'200.00	0.02	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	15'000	2'000	0	17'000 CHF	94.09%	15'995'300.00	0.39	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	3'400	1'700	0	5'100 CHF	91.60%	4'671'600.00	0.12	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNIX 0 08/26/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	9'400	0	3'000	6'400 CHF	97.15%	6'217'600.00	0.15	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	3'000	0	1'000	2'000 CHF	87.25%	1'745'000.00	0.04	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	5'000	0	0	5'000 CHF	90.90%	4'545'000.00	0.11	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	3'300	0	0	3'300 CHF	94.24%	3'109'920.00	0.08	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	3'200	0	0	3'200 CHF	88.90%	2'844'800.00	0.07	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	4'270	1'130	0	5'400 CHF	98.77%	5'333'580.00	0.13	a)
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	3'500	3'000	0	6'500 CHF	94.05%	6'113'250.00	0.15	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	0	1'500	0	1'500 CHF	95.35%	1'430'250.00	0.04	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	20'000	0	0	20'000 CHF	94.50%	18'900'000.00	0.47	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	1'000	0	0	1'000 CHF	92.50%	925'000.00	0.02	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	11'000	0	0	11'000 CHF	93.90%	10'329'000.00	0.25	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	9'400	0	0	9'400 CHF	92.02%	8'649'880.00	0.21	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	2'800	0	2'000	800 CHF	94.35%	754'800.00	0.02	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	9'150	1'650	0	10'800 CHF	98.92%	10'683'360.00	0.26	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	10'000	0	0	10'000 CHF	92.95%	9'295'000.00	0.23	a)
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	8'000	0	0	8'000 CHF	95.90%	7'672'000.00	0.19	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	26'500	0	0	26'500 CHF	95.55%	25'320'750.00	0.62	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	6'400	1'000	0	7'400 CHF	97.50%	7'215'000.00	0.18	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	17'500	0	1'000	16'500 CHF	95.07%	15'686'550.00	0.39	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	10'000	0	0	10'000 CHF	95.93%	9'593'000.00	0.24	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	5'600	0	0	5'600 CHF	98.93%	5'540'080.00	0.14	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	5'000	5'200	4'200	6'000 CHF	99.50%	5'970'000.00	0.15	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	5'000	0	3'250	1'750 CHF	99.50%	1'741'250.00	0.04	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'000	0	0	6'000 CHF	88.40%	5'304'000.00	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	10'000	0	1'500	8'500 CHF	97.95%	8'325'750.00	0.21	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	4'500	0	0	4'500 CHF	99.51%	4'477'950.00	0.11	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	14'500	0	0	14'500 CHF	99.80%	14'471'000.00	0.36	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	3'700	0	0	3'700 CHF	99.85%	3'694'450.00	0.09	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	2'200	0	0	2'200 CHF	106.85%	2'350'700.00	0.06	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	12'000	0	7'000	5'000 CHF	101.10%	5'055'000.00	0.12	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	5'000	0	0	5'000 CHF	103.80%	5'190'000.00	0.13	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	4'500	0	0	4'500 CHF	100.98%	4'544'100.00	0.11	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	23'000	0	4'500	18'500 CHF	103.70%	19'184'500.00	0.47	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	1'400	0	0	1'400 CHF	102.35%	1'432'900.00	0.04	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	16'250	1'325	0	17'575 CHF	103.60%	18'207'700.00	0.45	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	3'300	0	0	3'300 CHF	107.77%	3'556'410.00	0.09	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	14'250	4'000	0	18'250 CHF	102.25%	18'660'625.00	0.46	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.22%	1'002'200.00	0.02	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	19'000	1'000	0	20'000 CHF	103.32%	20'664'000.00	0.51	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	15'000	0	5'000	10'000 CHF	106.10%	10'610'000.00	0.26	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	15'700	0	7'500	8'200 CHF	114.12%	9'357'840.00	0.23	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	18'800	0	2'500	16'300 CHF	103.37%	16'849'310.00	0.42	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	4'400	5'600	0	10'000 CHF	105.96%	10'596'000.00	0.26	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	10'500	0	0	10'500 CHF	108.90%	11'434'500.00	0.28	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	8'500	0	2'500	6'000 CHF	102.75%	6'165'000.00	0.15	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	10'000	19'000	0	29'000 CHF	105.01%	30'452'900.00	0.75	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	6'000	0	0	6'000 CHF	104.20%	6'252'000.00	0.15	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	104.10%	5'205'000.00	0.13	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	6'000	0	0	6'000 CHF	109.58%	6'574'800.00	0.16	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	13'000	2'500	550	14'950 CHF	116.43%	17'406'285.00	0.43	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	12'000	0	0	12'000 CHF	131.65%	15'798'000.00	0.39	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.50%	10'150'000.00	0.25	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	116.60%	2'915'000.00	0.07	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	3'950	0	0	3'950 CHF	124.20%	4'905'900.00	0.12	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	0	1'300	0	1'300 CHF	100.02%	1'300'260.00	0.03	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	3'300	0	0	3'300 CHF	110.82%	3'657'060.00	0.09	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	0	6'500	0	6'500 CHF	103.60%	6'734'000.00	0.17	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	1'000	9'000 CHF	103.14%	9'282'600.00	0.23	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	21'000	4'500	10'000	15'500 CHF	107.25%	16'623'750.00	0.41	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	4'000	0	2'500	1'500 CHF	116.40%	1'746'000.00	0.04	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	13'000	0	0	13'000 CHF	122.05%	15'866'500.00	0.39	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	9'600	0	9'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	21'000	0	9'000	12'000 CHF	104.15%	12'498'000.00	0.31	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	5'000	0	500	4'500 CHF	106.95%	4'812'750.00	0.12	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	5'500	0	0	5'500 CHF	107.75%	5'926'250.00	0.15	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	6'000	3'000	3'000	6'000 CHF	109.97%	6'598'200.00	0.16	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	5'500	0	0	5'500 CHF	101.00%	5'555'000.00	0.14	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	3'000	1'000	0	4'000 CHF	103.55%	4'142'000.00	0.10	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	127.20%	6'360'000.00	0.16	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	6'500	0	0	6'500 CHF	104.60%	6'799'000.00	0.17	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	2'000	0	0	2'000 CHF	108.75%	2'175'000.00	0.05	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	1'000	0	0	1'000 CHF	109.28%	1'092'800.00	0.03	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	14'500	3'500	2'500	15'500 CHF	115.18%	17'852'900.00	0.44	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	0	2'300	0	2'300 CHF	114.05%	2'623'150.00	0.06	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	0	900	0	900 CHF	100.97%	908'730.00	0.02	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	4'500	0	0	4'500 CHF	101.84%	4'582'800.00	0.11	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	10'000	5'000	3'500	11'500 CHF	105.14%	12'091'100.00	0.30	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	9'000	0	0	9'000 CHF	108.13%	9'731'700.00	0.24	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	5'000	0	2'000	3'000 CHF	108.70%	3'261'000.00	0.08	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	10'000	0	0	10'000 CHF	103.40%	10'340'000.00	0.25	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	10'000	0	0	10'000 CHF	107.15%	10'715'000.00	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	9'500	0	0	9'500 CHF	120.30%	11'428'500.00	0.28	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	8'000	0	0	8'000 CHF	114.40%	9'152'000.00	0.23	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	8'000	0	0	8'000 CHF	137.80%	11'024'000.00	0.27	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	1'750	0	0	1'750 CHF	106.20%	1'858'500.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	10'000	10'000	0	20'000 CHF	104.10%	20'820'000.00	0.51	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	4'700	0	0	4'700 CHF	105.89%	4'976'830.00	0.12	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	5'450	0	0	5'450 CHF	111.28%	6'064'760.00	0.15	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	14'200	3'100	0	17'300 CHF	105.80%	18'303'400.00	0.45	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	10'000	0	0	10'000 CHF	104.50%	10'450'000.00	0.26	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	0	13'500	3'500	10'000 CHF	104.13%	10'413'000.00	0.26	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	4'000	5'000	0	9'000 CHF	107.80%	9'702'000.00	0.24	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	4'000	0	0	4'000 CHF	104.80%	4'192'000.00	0.10	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	3'500	0	0	3'500 CHF	110.30%	3'860'500.00	0.10	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	0	4'000	2'000	2'000 CHF	104.70%	2'094'000.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	37'500	0	1'000	36'500 CHF	106.27%	38'788'550.00	0.96	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	10'495	0	0	10'495 CHF	100.07%	10'502'346.50	0.26	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	2'000	1'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	31'700	0	1'400	30'300 CHF	111.96%	33'923'880.00	0.84	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	10'000	0	0	10'000 CHF	101.04%	10'104'000.00	0.25	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	5'140	1'735	0	6'875 CHF	106.35%	7'311'562.50	0.18	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	5'000	5'000	0	10'000 CHF	109.85%	10'985'000.00	0.27	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	30'500	0	0	30'500 CHF	112.58%	34'336'900.00	0.85	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	2'000	0	0	2'000 CHF	106.25%	2'125'000.00	0.05	a)
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	106.30%	1'063'000.00	0.03	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	2'500	0	2'500 CHF	114.25%	2'856'250.00	0.07	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	4'650	215	0	4'865 CHF	147.80%	7'190'470.00	0.18	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	10'000	0	0	10'000 CHF	101.75%	10'175'000.00	0.25	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	6'185	1'250	4'935 CHF	106.45%	5'253'307.50	0.13	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	10'000	0	2'000	8'000 CHF	106.30%	8'504'000.00	0.21	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	27'250	0	2'000	25'250 CHF	110.67%	27'944'175.00	0.69	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	1'000	0	0	1'000 CHF	107.90%	1'079'000.00	0.03	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	3'300	2'500	1'300	4'500 CHF	110.85%	4'988'250.00	0.12	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	9'450	0	2'500	6'950 CHF	114.81%	7'979'295.00	0.20	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	4'000	4'500	0	8'500 CHF	120.40%	10'234'000.00	0.25	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	15'000	0	15'000 CHF	107.06%	16'059'000.00	0.40	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	9'700	3'000	0	12'700 CHF	109.48%	13'903'960.00	0.34	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	11'250	0	4'000	7'250 CHF	113.95%	8'261'375.00	0.20	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	22'500	2'500	0	25'000 CHF	113.01%	28'252'500.00	0.70	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	0	5'000	0	5'000 CHF	105.90%	5'295'000.00	0.13	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	5'000	0	0	5'000 CHF	106.00%	5'300'000.00	0.13	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	5'000	0	0	5'000 CHF	108.05%	5'402'500.00	0.13	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	6'990	0	6'990 CHF	104.65%	7'315'035.00	0.18	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	6'000	0	1'500	4'500 CHF	113.20%	5'094'000.00	0.13	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'500	0	2'500 CHF	110.70%	2'767'500.00	0.07	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	5'000	0	0	5'000 CHF	113.40%	5'670'000.00	0.14	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	600	0	600 CHF	107.45%	644'700.00	0.02	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	6'800	0	6'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	3'850	0	0	3'850 CHF	108.35%	4'171'475.00	0.10	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	10'000	0	0	10'000 CHF	102.00%	10'200'000.00	0.25	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	5'000	0	2'000	3'000 CHF	108.10%	3'243'000.00	0.08	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	5'000	0	3'800	1'200 CHF	104.65%	1'255'800.00	0.03	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	5'000	0	0	5'000 CHF	108.85%	5'442'500.00	0.13	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	2'700	6'530	0	9'230 CHF	112.10%	10'346'830.00	0.25	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	5'000	3'000	1'600	6'400 CHF	101.75%	6'512'000.00	0.16	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	5'000	6'000	0	11'000 CHF	108.90%	11'979'000.00	0.30	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	16'000	0	0	16'000 CHF	112.26%	17'961'600.00	0.44	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	5'000	0	5'000 CHF	104.35%	5'217'500.00	0.13	a)
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	0	8'000	0	8'000 CHF	108.15%	8'652'000.00	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	3'750	0	3'750 CHF	108.45%	4'066'875.00	0.10	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	4'000	0	4'000 CHF	111.35%	4'454'000.00	0.11	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	5'800	0	5'800 CHF	108.95%	6'319'100.00	0.16	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	5'500	0	5'500 CHF	101.50%	5'582'500.00	0.14	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	10'500	0	10'500 CHF	102.13%	10'723'650.00	0.26	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	35'000	0	35'000 CHF	103.71%	36'298'500.00	0.89	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	0	4'000	0	4'000 CHF	105.51%	4'220'400.00	0.10	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	5'000	0	5'000 CHF	102.65%	5'132'500.00	0.13	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	9'335	3'500	5'835 CHF	108.40%	6'325'140.00	0.16	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1307121264	2.2500 % KWLLIJ 2 1/4 12/05/25	0	6'500	3'000	3'500 CHF	101.30%	3'545'500.00	0.09	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLLIJ 2 3/8 12/05/29	0	5'000	0	5'000 CHF	105.85%	5'292'500.00	0.13	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	15'500	15'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346304	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 03/25/33	0	5'000	0	5'000 CHF	103.95%	5'197'500.00	0.13	a)
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	7'000	0	7'000 CHF	108.55%	7'598'500.00	0.19	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	9'220	700	8'520 CHF	103.50%	8'818'200.00	0.22	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	7'100	5'500	1'600 CHF	106.20%	1'699'200.00	0.04	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	9'500	0	9'500 CHF	102.75%	9'761'250.00	0.24	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	5'000	0	5'000 CHF	104.48%	5'224'000.00	0.13	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	103.85%	2'077'000.00	0.05	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	3'000	0	3'000 CHF	106.25%	3'187'500.00	0.08	a)
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	2'500	0	2'500 CHF	104.05%	2'601'250.00	0.06	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	5'000	0	5'000 CHF	104.95%	5'247'500.00	0.13	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	4'100	0	4'100 CHF	103.65%	4'249'650.00	0.10	a)
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	15'000	0	15'000 CHF	105.70%	15'855'000.00	0.39	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	1'200	0	1'200 CHF	101.50%	1'218'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	7'000	0	7'000 CHF	105.90%	7'413'000.00	0.18	a)
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	10'000	2'500	7'500 CHF	108.25%	8'118'750.00	0.20	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	5'100	5'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1346742930	1.9000 % PGHNSW 1.9 06/07/30	0	3'800	0	3'800 CHF	103.95%	3'950'100.00	0.10	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	5'000	0	5'000 CHF	106.65%	5'332'500.00	0.13	a)
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	5'000	0	5'000 CHF	102.70%	5'135'000.00	0.13	a)
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	0	1'750	0	1'750 CHF	105.40%	1'844'500.00	0.05	a)
CH1348614152	2.1125 % UBS 2.1125 05/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	103.45%	2'069'000.00	0.05	a)
CH1348614194	1.3000 % ZURCTY 1.3 06/04/49	0	2'500	0	2'500 CHF	109.45%	2'736'250.00	0.07	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	3'000	1'300	1'700 CHF	102.80%	1'747'600.00	0.04	a)
CH1349302930	0.9750 % ACANXB 0.975 04/23/29	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1350727785	1.6500 % SCMNXX 1.65 08/23/30	0	5'000	0	5'000 CHF	103.75%	5'187'500.00	0.13	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNXX 1.8 08/23/34	0	11'000	0	11'000 CHF	106.50%	11'715'000.00	0.29	a)
CH1353015014	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 JUL	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	2'000	0	2'000 CHF	104.40%	2'088'000.00	0.05	a)
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	6'000	0	6'000 CHF	104.75%	6'285'000.00	0.15	a)
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	8'000	0	8'000 CHF	107.00%	8'560'000.00	0.21	a)
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	8'000	0	8'000 CHF	111.10%	8'888'000.00	0.22	a)
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	8'000	0	8'000 CHF	116.80%	9'344'000.00	0.23	a)
CH1353257863	1.9500 % HELNSW 1.95 06/26/34	0	1'500	0	1'500 CHF	106.10%	1'591'500.00	0.04	a)
CH1353257939	1.6250 % KWOBBER 1 5/8 07/16/32	0	6'400	0	6'400 CHF	103.55%	6'627'200.00	0.16	a)
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	0	10'000	0	10'000 CHF	103.59%	10'359'000.00	0.26	a)
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.12	a)
CH1371736740	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 AUG	0	10'500	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1371736807	0.9850 % ROSW 0.985 09/06/29	0	12'000	0	12'000 CHF	100.80%	12'096'000.00	0.30	a)
CH1371736815	1.0975 % ROSW 1.0975 09/06/34	0	10'000	0	10'000 CHF	100.90%	10'090'000.00	0.25	a)
CH1371736823	1.1700 % ROSW 1.17 09/06/39	0	11'750	0	11'750 CHF	101.10%	11'879'250.00	0.29	a)
CH1373904270	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/08/34	0	3'500	0	3'500 CHF	100.25%	3'508'750.00	0.09	a)
CH1373904288	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/09/50	0	4'500	0	4'500 CHF	99.75%	4'488'750.00	0.11	a)
CH1373904445	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 SEP	0	7'500	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1373904478	1.6000 % KSGRAU 1.6 09/27/34	0	1'500	0	1'500 CHF	101.70%	1'525'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1373904486	0.8500 % ZURICH 0.85 09/24/36	0	10'000	0	10'000 CHF	100.95%	10'095'000.00	0.25	a)
CH1373904510	1.6000 % KWLIL 1.6 10/15/32	0	5'500	0	5'500 CHF	101.90%	5'604'500.00	0.14	a)
CH1373904536	1.0000 % WINCTY 1 09/29/51	0	10'000	0	10'000 CHF	101.20%	10'120'000.00	0.25	a)
CH1377443804	1.6500 % ZUGNSW 1.65 09/16/31	0	4'500	0	4'500 CHF	101.15%	4'551'750.00	0.11	a)
CH1380011309	1.6000 % EMMI 1.6 10/30/34	0	4'000	0	4'000 CHF	101.65%	4'066'000.00	0.10	a)
CH1380910245	1.5500 % KSBAAR 1.55 11/06/31	0	3'000	0	3'000 CHF	100.89%	3'026'640.00	0.07	a)
CH1380910260	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 11/10/64	0	5'000	0	5'000 CHF	106.72%	5'336'000.00	0.13	a)
CH1380910302	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 OCT	0	40'000	0	40'000 CHF	105.89%	42'354'800.00	1.04	a)
CH1380910351	0.9000 % BERCTY 0.9 11/01/33	0	5'000	0	5'000 CHF	99.90%	4'995'000.00	0.12	a)
CH1380910369	1.1250 % BERCTY 1 1/8 11/01/44	0	5'000	0	5'000 CHF	102.20%	5'110'000.00	0.13	a)
CH1380910377	1.5000 % ISHZ 1 1/2 11/08/29	0	2'000	0	2'000 CHF	100.19%	2'003'840.00	0.05	a)
CH1383927428	1.0000 % KBAARG 1 10/17/30	0	30'000	0	30'000 CHF	100.55%	30'165'000.00	0.74	a)
CH1388731346	0.9000 % TESSIN 0.9 10/14/55	0	10'500	0	10'500 CHF	102.30%	10'741'500.00	0.26	a)
CH							2'882'457'382.00	71.01	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0 1 09/18/26 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	97.70%	8'793'000.00	0.22	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	7'200	0	0	7'200 CHF	98.45%	7'088'400.00	0.17	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CL							15'881'400.00	0.39	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	101.51%	3'857'380.00	0.10	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	7'000	1'500	8'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	97.75%	2'443'750.00	0.06	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMTN	520	0	520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.02	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	99.82%	2'595'320.00	0.06	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	3'000	460	0	3'460 CHF	94.25%	3'261'050.00	0.08	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'000	3'000	0	8'000 CHF	96.70%	7'736'000.00	0.19	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	97.25%	3'890'000.00	0.10	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	90.05%	2'701'500.00	0.07	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	97.45%	3'508'200.00	0.09	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	3'500	0	3'000	500 CHF	93.95%	469'750.00	0.01	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	7'800	0	0	7'800 CHF	97.55%	7'608'900.00	0.19	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	7'000	0	6'000	1'000 CHF	95.80%	958'000.00	0.02	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	98.73%	7'503'480.00	0.18	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	5'000	6'000	0	11'000 CHF	107.90%	11'869'000.00	0.29	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	120.10%	10'809'000.00	0.27	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	5'000	0	4'400	600 CHF	106.45%	638'700.00	0.02	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTM	0	2'000	0	2'000 CHF	105.75%	2'115'000.00	0.05	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	10'500	0	1'000	9'500 CHF	101.55%	9'647'250.00	0.24	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 CHF	105.95%	3'178'500.00	0.08	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	111.05%	8'884'000.00	0.22	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	109.15%	4'366'000.00	0.11	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.90%	1'039'000.00	0.03	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.95%	5'247'500.00	0.13	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	102.10%	2'552'500.00	0.06	a)
CH1356570320	1.9875 % CMZB 1.9875 09/09/31	0	4'500	0	4'500 CHF	102.10%	4'594'500.00	0.11	a)
CH1357852750	1.5100 % BHH 1.51 07/31/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.03	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.20%	5'110'000.00	0.13	a)
CH1380508411	2.0725 % DB 2.0725 09/18/30 EMTN	0	7'400	0	7'400 CHF	101.65%	7'522'100.00	0.19	a)
DE							126'085'380.00	3.11	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	105.15%	10'515'000.00	0.26	a)
DK							10'515'000.00	0.26	
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	99.97%	3'598'920.00	0.09	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	1'400	0	0	1'400 CHF	98.45%	1'378'300.00	0.03	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	6'300	0	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	101.68%	12'201'600.00	0.30	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	10'500	0	0	10'500 CHF	101.55%	10'662'750.00	0.26	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	7'500	3'000	0	10'500 CHF	105.80%	11'109'000.00	0.27	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSFC 2.9325 07/04/28 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	5'200	0	5'200 CHF	104.40%	5'428'800.00	0.13	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	106.95%	8'556'000.00	0.21	a)
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	0	4'700	0	4'700 CHF	102.80%	4'831'600.00	0.12	a)
ES							57'766'970.00	1.42	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	98.85%	1'186'200.00	0.03	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	103.35%	10'335'000.00	0.25	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	11'000	0	200	10'800 CHF	105.10%	11'350'800.00	0.28	a)
FI							22'872'000.00	0.56	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	10'000	0	5'000	5'000 CHF	100.41%	5'020'500.00	0.12	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	0	4'680	0	4'680 CHF	104.20%	4'876'560.00	0.12	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	4'320	0	0	4'320 CHF	101.74%	4'395'168.00	0.11	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	6'000	500	5'500 CHF	98.60%	5'423'000.00	0.13	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	99.05%	7'924'000.00	0.20	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	2'000	4'600	0	6'600 CHF	99.87%	6'591'420.00	0.16	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	99.55%	1'194'600.00	0.03	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	4'600	0	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	0	1'890	1'890	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 CHF	96.05%	2'881'500.00	0.07	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	96.80%	3'872'000.00	0.10	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	97.20%	2'527'200.00	0.06	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	5'000	0	400	4'600 CHF	96.10%	4'420'600.00	0.11	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'400	4'200	0	5'600 CHF	96.40%	5'398'400.00	0.13	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	96.10%	7'688'000.00	0.19	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	96.20%	1'924'000.00	0.05	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 CHF	97.50%	3'900'000.00	0.10	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	13'000	0	0	13'000 CHF	97.65%	12'694'500.00	0.31	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	3'400	0	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	7'800	0	4'200	3'600 CHF	97.05%	3'493'800.00	0.09	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	102.85%	3'085'500.00	0.08	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	106.50%	5'325'000.00	0.13	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.83%	2'036'600.00	0.05	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	10'000	6'000	16'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	107.95%	5'397'500.00	0.13	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	106.85%	2'137'000.00	0.05	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	8'000	0	3'000	5'000 CHF	107.85%	5'392'500.00	0.13	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	10'750	0	10'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	105.00%	10'500'000.00	0.26	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	106.15%	2'759'900.00	0.07	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	104.85%	7'339'500.00	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	10'000	1'500	8'500 CHF	104.90%	8'916'500.00	0.22	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	10'000	2'500	0	12'500 CHF	106.45%	13'306'250.00	0.33	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	103.55%	5'177'500.00	0.13	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	8'000	3'000	5'000 CHF	105.75%	5'287'500.00	0.13	a)
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	0	12'000	0	12'000 CHF	106.40%	12'768'000.00	0.31	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	2'600	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
FR							173'654'498.00	4.28	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	2'000	5'865	0	7'865 CHF	99.92%	7'858'708.00	0.19	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	97.85%	7'436'600.00	0.18	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	14'000	0	0	14'000 CHF	97.90%	13'706'000.00	0.34	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	6'400	0	0	6'400 CHF	95.20%	6'092'800.00	0.15	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	6'400	0	4'200	2'200 CHF	97.25%	2'139'500.00	0.05	a)
CH1236363409	1.7575 % NWISE 1.7575 01/23/26	5'000	300	0	5'300 CHF	101.03%	5'354'590.00	0.13	a)
CH1236363417	2.0125 % NWISE 2.0125 01/23/30	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	12'000	1'000	0	13'000 CHF	106.10%	13'793'000.00	0.34	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	5'000	0	600	4'400 CHF	103.05%	4'534'200.00	0.11	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	5'000	0	1'200	3'800 CHF	102.15%	3'881'700.00	0.10	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	5'000	1'200	0	6'200 CHF	105.65%	6'550'300.00	0.16	a)
CH1357852818	1.4450 % NWG 1.445 08/27/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.40%	4'056'000.00	0.10	a)
GB							75'403'398.00	1.86	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	10'000	2'400	12'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
IE							0.00	0.00	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	14'000	0	0	14'000 CHF	99.95%	13'993'000.00	0.34	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'500	1'140	2'500	1'140 CHF	99.74%	1'137'036.00	0.03	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	100.10%	12'012'000.00	0.30	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	10'000	0	0	10'000 CHF	101.21%	10'121'000.00	0.25	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	10'000	0	0	10'000 CHF	101.17%	10'117'000.00	0.25	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	4'545	0	0	4'545 CHF	101.13%	4'596'358.50	0.11	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KR							51'976'394.50	1.28	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	500	4'200	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.05%	5'202'500.00	0.13	a)
LU							5'202'500.00	0.13	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	1'000	500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	3'000	0	500	2'500 CHF	104.20%	2'605'000.00	0.06	a)
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	4'480	0	0	4'480 CHF	88.00%	3'942'400.00	0.10	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	2'500	0	0	2'500 CHF	97.75%	2'443'750.00	0.06	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	1'000	0	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.02	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	1'500	0	0	1'500 CHF	100.90%	1'513'500.00	0.04	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	100.40%	3'212'800.00	0.08	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	10'000	0	2'000	8'000 CHF	104.40%	8'352'000.00	0.21	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	105.30%	10'530'000.00	0.26	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	10'000	0	1'600	8'400 CHF	105.00%	8'820'000.00	0.22	a)
CH1353257749	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 EMTN	0	10'500	0	10'500 CHF	107.00%	11'235'000.00	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1380011226	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 OCT	0	7'500	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
NL							53'610'450.00	1.32	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	96.10%	576'600.00	0.01	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	100.30%	2'657'950.00	0.07	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	4'000	0	500	3'500 CHF	101.55%	3'554'250.00	0.09	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.00%	5'100'000.00	0.13	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	104.75%	2'304'500.00	0.06	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	105.70%	10'570'000.00	0.26	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	5'000	0	400	4'600 CHF	103.00%	4'738'000.00	0.12	a)
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	103.10%	10'310'000.00	0.25	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.60%	5'130'000.00	0.13	a)
CH1357852826	1.3075 % NONGNO 1.3075 08/28/30 EMTN	0	7'500	0	7'500 CHF	101.25%	7'593'750.00	0.19	a)
NO							52'535'050.00	1.29	
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357520433	0.2500 % ANZLN 0 1/4 09/22/25 EMTN	8'000	0	1'000	7'000 CHF	99.46%	6'962'200.00	0.17	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZLN 0.35 10/22/24 EMTN	3'750	4'300	8'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'750	0	200	1'550 CHF	97.00%	1'503'500.00	0.04	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.80%	5'140'000.00	0.13	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	108.35%	5'417'500.00	0.13	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	3'750	0	250	3'500 CHF	105.90%	3'706'500.00	0.09	a)
NZ							22'729'700.00	0.56	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	500	1'000	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.45%	994'500.00	0.02	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	5'910	0	0	5'910 CHF	97.70%	5'774'070.00	0.14	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	550	0	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	100.10%	4'004'000.00	0.10	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	106.40%	10'640'000.00	0.26	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	109.35%	1'640'250.00	0.04	a)
SE							23'052'820.00	0.57	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	10'000	0	0	10'000 CHF	100.70%	10'070'000.00	0.25	a)
SG							10'070'000.00	0.25	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	2'250	0	0	2'250 CHF	99.96%	2'249'100.00	0.06	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	13'910	0	13'910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'500	3'000	0	4'500 CHF	98.05%	4'412'250.00	0.11	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	8'000	5'000	0	13'000 CHF	97.95%	12'733'500.00	0.31	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	4'500	0	3'000	1'500 CHF	96.55%	1'448'250.00	0.04	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.25%	2'887'500.00	0.07	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	10'000	2'000	8'000 CHF	104.50%	8'360'000.00	0.21	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	10'000	0	10'000 CHF	107.55%	10'755'000.00	0.26	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	1'150	0	1'150 CHF	101.05%	1'162'075.00	0.03	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	105.25%	8'420'000.00	0.21	a)
US							52'427'675.00	1.29	
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	4'000	10'000	0	14'000 CHF	111.05%	15'547'000.00	0.38	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	6'450	7'200	0	13'650 CHF	103.55%	14'134'575.00	0.35	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	4'000	0	0	4'000 CHF	109.05%	4'362'000.00	0.11	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	1'500	270	1'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	4'850	0	4'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	5'000	0	2'500	2'500 CHF	99.74%	2'493'500.00	0.06	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	8'250	4'900	0	13'150 CHF	91.40%	12'019'100.00	0.30	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.95%	1'919'000.00	0.05	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	94.25%	6'597'500.00	0.16	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	98.50%	2'955'000.00	0.07	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.00%	5'150'000.00	0.13	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	9'650	0	0	9'650 CHF	103.00%	9'939'500.00	0.24	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	105.29%	3'158'700.00	0.08	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	5'000	0	0	5'000 CHF	103.40%	5'170'000.00	0.13	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	5'000	1'000	0	6'000 CHF	104.55%	6'273'000.00	0.15	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	5'000	0	3'000	2'000 CHF	106.65%	2'133'000.00	0.05	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	10'000	5'000	0	15'000 CHF	103.75%	15'562'500.00	0.38	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	15'000	3'000	0	18'000 CHF	107.30%	19'314'000.00	0.48	a)
CH1335850330	0.6925 % EIB 0.6925 10/15/32	0	10'000	0	10'000 CHF	100.70%	10'070'000.00	0.25	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	2'500	2'000	500 CHF	102.35%	511'750.00	0.01	a)
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	0	4'950	0	4'950 CHF	103.40%	5'118'300.00	0.13	a)
CH1356570346	0.7400 % IBRD 0.74 10/16/34	0	10'000	0	10'000 CHF	100.30%	10'030'000.00	0.25	a)
CH1380011267	2.0725 % FNPLAT 2.0725 10/24/29	0	5'000	0	5'000 CHF	101.00%	5'050'000.00	0.12	a)
XS							157'508'425.00	3.88	

Derivative Finanzinstrumente

-2'588'511.38 -0.06

Swaps

-2'588'511.38 -0.06

08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	-15'000	15'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	-30'000	30'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	30'000	0	30'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/36	IRS FIX LEG 1.31% P.A. CHF	0	0	25'000	-25'000 CHF	108.36%	-27'090'875.59	-0.67	b)
06/36	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	25'000	0	25'000 CHF	100.00	25'000'000.00	0.62	b)
10/36	IRS FIX LEG 0.6725% P.A. CHF	0	0	40'000	-40'000 CHF	100.97%	-40'386'022.47	-0.99	b)
10/36	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	40'000	0	40'000 CHF	100.00	40'000'000.00	0.99	b)
10/44	IRS FIX LEG 0.7425% P.A. CHF	0	0	5'000	-5'000 CHF	102.23%	-5'111'613.32	-0.13	b)
10/44	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	5'000	0	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.12	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'400'000.00	0.06
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'029'599'203.00	99.27
Derivative Finanzinstrumente	-2'588'511.38	-0.06
Sonstige Vermögenswerte	29'729'600.16	0.73
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'059'140'291.78	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'013'209.32	
Andere Verbindlichkeiten	-810'792.61	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'057'316'289.85	

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);	4'029'599'203.00	99.27
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'588'511.38	-0.06
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts

OTC COLLATERAL IV-BFNCHF CHF ZKB	2'400'000 CHF	2'400'000.00
----------------------------------	---------------	--------------

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	72'588'511.38	1.789

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

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	0.850	1.300	0.650	0.200	2.000
BA CHF	0.530	1.000	0.330	0.200	2.000
CT CHF	0.490	0.850	0.290	0.200	2.000
DT CHF	0.400	0.750	0.300	0.100	2.000
GT CHF	0.380	0.650	0.280	0.100	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Swiss Bond Index (SBI)® AAA-BBB Total Return

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.35000	0.12250	0.22750
BA CHF	Nein	CHF	0.65000	0.22750	0.42250

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.71403	0.24991	0.46412
DT CHF	Nein	CHF	0.83792	0.29327	0.54465
GT CHF	Nein	CHF	0.82464	0.28862	0.53602
NT CHF	Nein	CHF	14.987	5.245	9.742

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

6 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'348'549'312.90	3'496'577'565.64	3'159'582'238.76	2'869'261'027.83
Klasse AA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'712'735.06	1'278'663.18	813'291.94	1'100'763.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		17'779.498	14'177.519	9'273.691	11'193.233
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		96.3320	90.1895	87.6988	98.3419
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.6403	89.9460	87.9795	98.2632
Ausschüttung je Anteil		0.30	0.15	-	0.20
Total Expense Ratio (TER)		0.75 %	0.75 %	0.75 %	0.75 %
Klasse BA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'953'197.04	27'089'269.35		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		198'036.954	261'280.325		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		110.8540	103.6789		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.2088	103.3990		
Ausschüttung je Anteil		0.65	0.35		
Total Expense Ratio (TER)		0.48 %	0.48 %		
Klasse CT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'047'499.73	48'800'456.65	35'825'097.13	39'741'544.92
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		524'347.321	526'779.807	398'689.491	396'167.653
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		99.2615	92.6392	89.8571	100.3150
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.5791	92.3891	90.1447	100.2347
Thesaurierung je Anteil		0.59	0.39	0.13	0.18
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'893'639.77	12'084'284.27	5'553'157.32	1'736'100.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'973.222	11'954.045	5'666.954	1'587.999
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'083.8785	1'010.8950	979.9193	1'093.2632
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'087.3469	1'008.1656	983.0550	1'092.3886
Thesaurierung je Anteil		7.59	5.33	2.47	3.11
Total Expense Ratio (TER)		0.35 %	0.35 %	0.35 %	0.35 %
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		895'823'278.74	928'900'915.37	975'640'158.97	980'708'587.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'937'016.089	9'940'682.442	10'775'657.227	9'713'030.731
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		100.2374	93.4444	90.5411	100.9683
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.5582	93.1921	90.8309	100.8876
Thesaurierung je Anteil		0.77	0.55	0.29	0.35
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %
Klasse MT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'524'432.27	2'250'108.09	2'176'351.01	2'422'627.49
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'098.455	25'000.000	25'000.000	25'000.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		96.7273	90.0043	87.0540	96.9051
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		97.0368	89.7613	87.3326	96.8276
Thesaurierung je Anteil		1.00	0.78	0.54	0.61
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'362'594'530.29	2'476'173'868.73	2'139'574'182.39	1'843'551'403.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'321'578.203	1'837'280.638	1'641'330.839	1'270'475.073
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'448.4089	1'347.7385	1'303.5606	1'451.0725
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'453.0438	1'344.0996	1'307.7320	1'449.9116
Thesaurierung je Anteil		15.04	11.74	8.13	9.27
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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	7.62 %	6.87 %	-12.17 %	-2.40 %
Klasse BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	7.91 %	7.16 %	-0.65 %	-
Klasse CT CHF	7.94 %	7.19 %	-11.91 %	-2.11 %
Klasse DT CHF	7.41 %	7.26 %	-11.54 %	-2.01 %
Klasse GT CHF	7.49 %	7.33 %	-11.47 %	-1.94 %
Klasse MT CHF	8.43 %	7.68 %	-11.51 %	-1.67 %
Klasse NT CHF	7.79 %	7.63 %	-11.23 %	-1.67 %
Benchmark	7.16 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	0.23 %	0.44 %	0.62 %	0.25 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse AA CHF	0.46 %
Klasse BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	0.75 %
Klasse CT CHF	0.78 %
Klasse DT CHF	0.25 %
Klasse GT CHF	0.33 %
Klasse MT CHF	1.27 %
Klasse NT CHF	0.63 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	8'200'000.32	58'286'821.32
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'336'013'115.80	3'418'399'533.54
Derivative Finanzinstrumente	-8'537'007.27	-1'410'848.75
Sonstige Vermögenswerte	28'311'765.63	21'564'288.01
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'363'987'874.48	3'496'839'794.12
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-15'193'230.06	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-245'331.52	-262'228.48
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'348'549'312.90	3'496'577'565.64

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'177.519	9'273.691
Ausgegebene Anteile		8'771.570	6'128.484
Zurückgenommene Anteile		-5'169.591	-1'224.656
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		17'779.498	14'177.519
Klasse BA CHF			
			<i>Lancierung</i>
			27.12.2022
			31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		261'280.325	-
Ausgegebene Anteile		41'270.610	291'853.452
Zurückgenommene Anteile		-104'513.981	-30'573.127
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		198'036.954	261'280.325
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		526'779.807	398'689.491
Ausgegebene Anteile		135'205.100	212'810.936
Zurückgenommene Anteile		-137'637.586	-84'720.620
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		524'347.321	526'779.807
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'954.045	5'666.954
Ausgegebene Anteile		2'606.974	7'197.730
Zurückgenommene Anteile		-3'587.797	-910.639
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		10'973.222	11'954.045
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'940'682.442	10'775'657.227
Ausgegebene Anteile		1'930'787.388	1'816'847.556
Zurückgenommene Anteile		-2'934'453.741	-2'651'822.341
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'937'016.089	9'940'682.442
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		25'000.000	25'000.000
Ausgegebene Anteile		1'098.455	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'098.455	25'000.000
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'837'280.638	1'641'330.839
Ausgegebene Anteile		253'727.680	175'522.378
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		419'271.701	139'468.800
Zurückgenommene Anteile		-158'128.721	-88'103.312
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-30'573.095	-30'938.067
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'321'578.203	1'837'280.638

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	19.03.2024	224'313'871.25	162'268.663
Klasse NT CHF	19.03.2024	106'434'853.40	76'994.977
Klasse NT CHF	19.03.2024	172'361'088.53	124'686.018
Klasse NT CHF	20.03.2024	4'668'840.75	3'373.590
Klasse NT CHF	13.08.2024	8'372'083.08	5'816.501
Klasse NT CHF	30.09.2024	66'802'429.52	46'131.952

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	20.06.2024	7'682'003.61	5'481.257
Klasse NT CHF	21.08.2024	36'177'246.42	25'091.838

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'496'577'565.64	3'159'582'238.76
Ausbezahlte Ausschüttung		-66'112.20	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-9'775'512.76	-6'312'397.60
Saldo aus dem Anteilverkehr		563'754'386.18	227'982'335.44
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		298'058'986.04	115'325'389.04
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'348'549'312.90	3'496'577'565.64

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		95'446.60	51'877.82
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		42'914'881.88	30'482'481.24
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'673'483.21	1'219'827.87
Total Ertrag		47'683'811.69	31'754'186.93
Aufwand			
Passivzinsen		-179.68	-15.15
Reglementarische Vergütungen		-2'913'018.74	-2'967'509.90
Sonstige Aufwendungen		-21.00	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'410'394.35	-1'267'156.53
Total Aufwand		-5'323'613.77	-4'234'681.58
Nettoertrag / Verlust		42'360'197.92	27'519'505.35
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-840'947.19	-81'149'908.08
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		1'976'816.81	1'480'179.48
Realisierter Erfolg		43'496'067.54	-52'150'223.25
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		254'562'918.50	167'475'612.29
Gesamterfolg		298'058'986.04	115'325'389.04

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	5'549.77	2'084.93
Vortrag des Vorjahres	659.91	701.61
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'209.68	2'786.54
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	5'333.85	2'126.63
Vortrag auf neue Rechnung	875.83	659.91
Total	6'209.68	2'786.54
Klasse BA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	125'113.68	96'727.54
Vortrag des Vorjahres	5'279.42	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	130'393.10	96'727.54
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	128'724.02	91'448.12
Vortrag auf neue Rechnung	1'669.08	5'279.42
Total	130'393.10	96'727.54
Klasse CT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	314'572.84	209'648.58
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	314'572.84	209'648.58
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	110'100.49	73'377.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	204'472.35	136'271.58
Total	314'572.84	209'648.58
Klasse DT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	83'374.01	63'801.90
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	83'374.01	63'801.90
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	29'180.90	22'330.67
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	54'193.11	41'471.23
Total	83'374.01	63'801.90
Klasse GT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	6'885'038.03	5'543'566.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'885'038.03	5'543'566.10
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'409'763.31	1'940'248.14
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'475'274.72	3'603'317.96
Total	6'885'038.03	5'543'566.10
Klasse MT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	26'216.06	19'613.62
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	26'216.06	19'613.62
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	9'175.62	6'864.77
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	17'040.44	12'748.85
Total	26'216.06	19'613.62
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	34'920'333.53	21'584'062.68
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	34'920'333.53	21'584'062.68
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'222'116.74	7'554'421.94
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	22'698'216.79	14'029'640.74
Total	34'920'333.53	21'584'062.68

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							4'336'013'115.80	99.36	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							4'336'013'115.80	99.36	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'000	595	0	2'595 CHF	97.70%	2'535'315.00	0.06	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	98.20%	6'874'000.00	0.16	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	5'400	2'550	0	7'950 CHF	100.01%	7'950'795.00	0.18	a)
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	0	3'600	0	3'600 CHF	103.55%	3'727'800.00	0.09	a)
AE							21'087'910.00	0.48	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'000	0	0	1'000 CHF	127.80%	1'278'000.00	0.03	a)
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	3'000	8'000	1'000	10'000 CHF	94.30%	9'430'000.00	0.22	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	93.95%	7'516'000.00	0.17	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	104.05%	3'121'500.00	0.07	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	104.30%	2'503'200.00	0.06	a)
AT							23'848'700.00	0.55	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	98.90%	2'967'000.00	0.07	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'000	1'000	0	3'000 CHF	99.36%	2'980'800.00	0.07	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	8'400	1'500	0	9'900 CHF	99.88%	9'888'120.00	0.23	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	8'530	0	0	8'530 CHF	98.85%	8'431'905.00	0.19	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'000	4'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	2'300	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	1'000	2'000	1'300	1'700 CHF	96.70%	1'643'900.00	0.04	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	96.35%	1'927'000.00	0.04	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	97.65%	4'882'500.00	0.11	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	5'100	0	0	5'100 CHF	94.90%	4'839'900.00	0.11	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	100.65%	1'912'350.00	0.04	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	8'150	0	1'000	7'150 CHF	100.05%	7'153'575.00	0.16	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'000	0	0	2'000 CHF	104.70%	2'094'000.00	0.05	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	106.15%	2'123'000.00	0.05	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	12'000	300	1'000	11'300 CHF	105.55%	11'927'150.00	0.27	a)
AU							62'771'200.00	1.44	
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	5'000	1'150	0	6'150 CHF	99.93%	6'145'695.00	0.14	a)
BM							6'145'695.00	0.14	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	99.10%	4'955'000.00	0.11	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	3'100	600	0	3'700 CHF	95.30%	3'526'100.00	0.08	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'000	500	0	3'500 CHF	97.65%	3'417'750.00	0.08	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	11'250	0	0	11'250 CHF	99.30%	11'171'250.00	0.26	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	97.60%	1'464'000.00	0.03	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	96.60%	3'864'000.00	0.09	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	14'000	8'000	0	22'000 CHF	98.60%	21'692'000.00	0.50	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	595	0	595	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	99.60%	4'980'000.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	0	350	100	250 CHF	102.60%	256'500.00	0.01 a)	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.50%	5'175'000.00	0.12 a)	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'000	0	0	1'000 CHF	103.05%	1'030'500.00	0.02 a)	
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 CHF	103.75%	3'112'500.00	0.07 a)	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'500	1'000	0	3'500 CHF	104.50%	3'657'500.00	0.08 a)	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	5'000	0	0	5'000 CHF	104.45%	5'222'500.00	0.12 a)	
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	101.80%	3'563'000.00	0.08 a)	
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	3'000	500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	5'000	0	1'750	3'250 CHF	102.10%	3'318'250.00	0.08 a)	
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	5'000	1'750	0	6'750 CHF	105.50%	7'121'250.00	0.16 a)	
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	4'000	2'500	0	6'500 CHF	103.95%	6'756'750.00	0.15 a)	
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	102.95%	3'088'500.00	0.07 a)	
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	4'000	2'195	1'805 CHF	101.20%	1'826'660.00	0.04 a)	
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	103.30%	7'231'000.00	0.17 a)	
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	4'000	0	4'000 CHF	105.30%	4'212'000.00	0.10 a)	
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	105.30%	2'106'000.00	0.05 a)	
CH1353257905	2.0000 % BNS 2 08/02/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	105.15%	2'103'000.00	0.05 a)	
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	4'000	0	4'000 CHF	101.30%	4'052'000.00	0.09 a)	
CA							118'903'010.00	2.72	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	900	600	0	1'500 CHF	180.65%	2'709'750.00	0.06 a)	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	0	1'710	0	1'710 CHF	118.45%	2'025'495.00	0.05 a)	
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	15'800	0	15'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'500	9'000	0	14'500 CHF	100.55%	14'579'750.00	0.33 a)	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	3'000	0	0	3'000 CHF	109.59%	3'287'700.00	0.08 a)	
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	1'500	0	0	1'500 CHF	110.35%	1'655'250.00	0.04 a)	
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	39'300	0	8'500	30'800 CHF	106.81%	32'897'480.00	0.75 a)	
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	12'800	0	2'000	10'800 CHF	102.10%	11'026'800.00	0.25 a)	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'250	0	6'000	2'250 CHF	105.43%	2'372'175.00	0.05 a)	
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	2'400	0	0	2'400 CHF	108.65%	2'607'600.00	0.06 a)	
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	3'000	1'500	0	4'500 CHF	110.97%	4'993'650.00	0.11 a)	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	18'691	0	4'691	14'000 CHF	112.27%	15'717'800.00	0.36 a)	
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	5'000	0	0	5'000 CHF	116.81%	5'840'500.00	0.13 a)	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	0	1'000	0	1'000 CHF	110.01%	1'100'100.00	0.03 a)	
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132163434	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 06/30/31	0	1'500	0	1'500 CHF	109.60%	1'644'000.00	0.04 a)	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	3'000	0	0	3'000 CHF	100.94%	3'028'200.00	0.07 a)	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	18'000	0	8'500	9'500 CHF	105.60%	10'032'000.00	0.23 a)	
CH0180428531	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42	1'500	0	0	1'500 CHF	116.80%	1'752'000.00	0.04 a)	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	9'750	0	3'750	6'000 CHF	101.70%	6'102'000.00	0.14 a)	
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	2'000	250	0	2'250 CHF	101.90%	2'292'750.00	0.05 a)	
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	8'400	0	3'700	4'700 CHF	106.50%	5'005'500.00	0.11 a)	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	0	2'000	0	2'000 CHF	102.25%	2'045'000.00	0.05 a)	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	4'200	0	0	4'200 CHF	104.70%	4'397'400.00	0.10 a)	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	4'790	0	4'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	0	600	0	600 CHF	101.30%	607'800.00	0.01 a)	
CH0188335365	1.7500 % SCMNXX 1 3/4 07/10/24	8'400	0	8'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194958960	3.0000 % KWLILJ 3 09/27/52	1'400	0	0	1'400 CHF	123.55%	1'729'700.00	0.04 a)	
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	7'300	0	7'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000	600	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	1'000	0	1'000 CHF	104.10%	1'041'000.00	0.02	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.18%	1'001'800.00	0.02	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	0	5'500	0	5'500 CHF	101.88%	5'603'400.00	0.13	a)
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	2'250	2'180	4'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	4'500	600	4'500	600 CHF	108.20%	649'200.00	0.01	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	15'550	0	1'500	14'050 CHF	104.35%	14'661'175.00	0.34	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	0	500	0	500 CHF	115.70%	578'500.00	0.01	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	0	1'000	0	1'000 CHF	101.36%	1'013'600.00	0.02	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	5'000	0	0	5'000 CHF	162.25%	8'112'500.00	0.19	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	7'500	0	0	7'500 CHF	103.35%	7'751'250.00	0.18	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	0	1'026	1'026	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	1'000	1'000	0	2'000 CHF	111.10%	2'222'000.00	0.05	a)
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'500	0	2'500	2'000 CHF	100.05%	2'001'000.00	0.05	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	3'550	1'500	0	5'050 CHF	102.60%	5'181'300.00	0.12	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	0	500	0	500 CHF	118.50%	592'500.00	0.01	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	14'000	0	14'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	13'550	0	13'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	0	2'200	0	2'200 CHF	100.00%	2'200'000.00	0.05	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	15'000	1'000	5'000	11'000 CHF	102.96%	11'325'600.00	0.26	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247776138	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 07/14/26	0	240	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	1'500	5'000	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	3'000	0	0	3'000 CHF	105.80%	3'174'000.00	0.07	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	6'200	0	6'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	700	1'000	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	13'500	0	13'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	15'000	0	0	15'000 CHF	103.76%	15'564'000.00	0.36	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	10'665	0	10'665	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	7'200	0	0	7'200 CHF	100.07%	7'205'040.00	0.17	a)
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	0	3'500	0	3'500 CHF	107.44%	3'760'400.00	0.09	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	5'400	1'600	0	7'000 CHF	100.05%	7'003'500.00	0.16	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	11'000	500	5'000	6'500 CHF	99.93%	6'495'450.00	0.15	a)
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	0	1'800	0	1'800 CHF	100.03%	1'800'540.00	0.04	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	0	640	0	640 CHF	97.30%	622'720.00	0.01	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	2'800	7'000	5'250	4'550 CHF	98.97%	4'503'135.00	0.10	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	0	5'000	0	5'000 CHF	98.40%	4'920'000.00	0.11	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	3'000	2'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	0	2'000	0	2'000 CHF	102.45%	2'049'000.00	0.05	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	6'500	1'000	2'000	5'500 CHF	99.06%	5'448'300.00	0.12	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	0	4'000	0	4'000 CHF	102.10%	4'084'000.00	0.09	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	0	600	0	600 CHF	99.60%	597'600.00	0.01	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	0	5'000	0	5'000 CHF	99.50%	4'975'000.00	0.11	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	0	9'695	0	9'695 CHF	99.00%	9'598'050.00	0.22	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'740	500	5'000	3'240 CHF	97.70%	3'165'480.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	7'100	700	0	7'800 CHF	99.61%	7'769'580.00	0.18 a)	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	4'500	2'200	5'500	1'200 CHF	97.28%	1'167'360.00	0.03 a)	
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'500	0	0	1'500 CHF	100.06%	1'500'900.00	0.03 a)	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	0	550	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	4'000	0	0	4'000 CHF	99.78%	3'991'200.00	0.09 a)	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	5'000	0	0	5'000 CHF	99.69%	4'984'500.00	0.11 a)	
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	800	8'000	5'800	3'000 CHF	99.81%	2'994'300.00	0.07 a)	
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	20'800	0	0	20'800 CHF	100.21%	20'843'680.00	0.48 a)	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	0	1'000	0	1'000 CHF	99.10%	991'000.00	0.02 a)	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	12'000	3'000	5'000	10'000 CHF	98.60%	9'860'000.00	0.23 a)	
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	0	2'700	0	2'700 CHF	98.85%	2'668'950.00	0.06 a)	
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	7'500	0	7'500 CHF	101.17%	7'587'750.00	0.17 a)	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	12'000	0	1'000	11'000 CHF	96.00%	10'560'000.00	0.24 a)	
CH0310646523	0.5000 % KBFRI8 0 1/2 02/23/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	0	6'100	0	6'100 CHF	99.71%	6'082'310.00	0.14 a)	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	0	3'000	0	3'000 CHF	95.30%	2'859'000.00	0.07 a)	
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'460	1'300	0	2'760 CHF	99.08%	2'734'608.00	0.06 a)	
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	4'500	0	4'500 CHF	97.53%	4'388'850.00	0.10 a)	
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	4'000	0	0	4'000 CHF	95.10%	3'804'000.00	0.09 a)	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	3'000	0	0	3'000 CHF	98.05%	2'941'500.00	0.07 a)	
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	0	5'500	0	5'500 CHF	91.10%	5'010'500.00	0.11 a)	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	4'000	0	0	4'000 CHF	91.25%	3'650'000.00	0.08 a)	
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	1'000	500	0	1'500 CHF	97.75%	1'466'250.00	0.03 a)	
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	7'500	3'400	1'000	9'900 CHF	90.38%	8'947'620.00	0.21 a)	
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	5'000	0	0	5'000 CHF	99.42%	4'971'000.00	0.11 a)	
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	8'500	0	0	8'500 CHF	89.10%	7'573'500.00	0.17 a)	
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	12'250	0	0	12'250 CHF	87.07%	10'666'075.00	0.24 a)	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	3'455	0	3'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	18'000	0	18'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	0	935	0	935 CHF	94.25%	881'237.50	0.02 a)	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	18'500	0	7'000	11'500 CHF	94.17%	10'829'550.00	0.25 a)	
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	3'000	0	0	3'000 CHF	89.10%	2'673'000.00	0.06 a)	
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	3'700	0	0	3'700 CHF	98.15%	3'631'550.00	0.08 a)	
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	2'000	0	0	2'000 CHF	90.00%	1'800'000.00	0.04 a)	
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	5'000	0	2'200	2'800 CHF	95.50%	2'674'000.00	0.06 a)	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	4'655	4'655	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	10'000	0	0	10'000 CHF	101.75%	10'175'000.00	0.23 a)	
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	20'300	800	2'600	18'500 CHF	100.14%	18'525'900.00	0.42 a)	
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'000	500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	3'400	200	0	3'600 CHF	99.40%	3'578'400.00	0.08 a)	
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	0	12'500	0	12'500 CHF	98.39%	12'298'750.00	0.28 a)	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	8'950	0	8'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	0	460	460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWILLI 2 12/11/23	9'500	0	9'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	9'000	0	1'000	8'000 CHF	96.70%	7'736'000.00	0.18	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	2'600	0	2'600 CHF	98.60%	2'563'600.00	0.06	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	1'000	5'000	0	6'000 CHF	99.60%	5'976'000.00	0.14	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	10'000	2'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	5'000	0	0	5'000 CHF	98.20%	4'910'000.00	0.11	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	10'000	0	0	10'000 CHF	98.65%	9'865'000.00	0.23	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	5'180	0	0	5'180 CHF	95.70%	4'957'260.00	0.11	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	0	750	0	750 CHF	99.56%	746'700.00	0.02	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	2'000	0	0	2'000 CHF	98.35%	1'967'000.00	0.05	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	4'800	0	0	4'800 CHF	97.85%	4'696'800.00	0.11	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	1'000	0	2'000 CHF	98.40%	1'968'000.00	0.05	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	15'000	800	9'000	6'800 CHF	99.04%	6'734'720.00	0.15	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	0	7'500	0	7'500 CHF	99.29%	7'446'750.00	0.17	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	7'900	1'000	0	8'900 CHF	99.68%	8'871'520.00	0.20	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	18'000	0	8'000	10'000 CHF	98.88%	9'888'000.00	0.23	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	4'000	700	0	4'700 CHF	100.45%	4'721'150.00	0.11	a)
CH0373476784	0.5000 % KBBSH 0 1/2 05/31/28	2'500	0	0	2'500 CHF	98.70%	2'467'500.00	0.06	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	0	4'000	0	4'000 CHF	95.60%	3'824'000.00	0.09	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	9'950	0	9'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	1'000	0	0	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.02	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'500	4'250	0	5'750 CHF	98.90%	5'686'750.00	0.13	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	11'800	0	7'250	4'550 CHF	98.50%	4'481'750.00	0.10	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	3'255	0	0	3'255 CHF	100.39%	3'267'694.50	0.07	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	0	1'000	0	1'000 CHF	98.20%	982'000.00	0.02	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	0	2'000	0	2'000 CHF	98.70%	1'974'000.00	0.05	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	2'200	0	0	2'200 CHF	99.93%	2'198'460.00	0.05	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	0	1'000	0	1'000 CHF	98.95%	989'500.00	0.02	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	0	3'800	0	3'800 CHF	98.80%	3'754'400.00	0.09	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	3'500	3'000	3'000	3'500 CHF	97.70%	3'419'500.00	0.08	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	3'000	0	0	3'000 CHF	98.87%	2'966'100.00	0.07	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	1'900	0	1'900 CHF	99.68%	1'893'920.00	0.04	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	7'000	0	0	7'000 CHF	99.00%	6'930'000.00	0.16	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	0	3'000	0	3'000 CHF	98.55%	2'956'500.00	0.07	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	0	335	0	335 CHF	95.55%	320'092.50	0.01	a)
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	6'100	0	6'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	0	1'800	0	1'800 CHF	98.85%	1'779'300.00	0.04	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	5'880	0	0	5'880 CHF	99.60%	5'856'480.00	0.13	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26	5'250	8'950	0	14'200 CHF	99.33%	14'104'860.00	0.32	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	4'500	0	4'500 CHF	99.69%	4'486'050.00	0.10	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	500	600	500	600 CHF	98.60%	591'600.00	0.01	a)
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	0	1'000	0	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.02	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	5'000	2'000	0	7'000 CHF	100.13%	7'009'100.00	0.16	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	5'000	0	0	5'000 CHF	100.25%	5'012'500.00	0.11	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	5'000	0	0	5'000 CHF	98.00%	4'900'000.00	0.11	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	14'250	0	3'000	11'250 CHF	98.16%	11'043'000.00	0.25	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	23'700	2'000	7'500	18'200 CHF	97.81%	17'801'420.00	0.41	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	0	4'000	2'885	1'115 CHF	95.90%	1'069'285.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	1'000	4'000	0	5'000 CHF	100.40%	5'020'000.00	0.12	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	5'500	4'000	0	9'500 CHF	97.15%	9'229'250.00	0.21	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	8'840	7'300	11'000	5'140 CHF	95.94%	4'931'316.00	0.11	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	5'000	0	1'000	4'000 CHF	95.70%	3'828'000.00	0.09	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	5'000	0	7'000 CHF	96.55%	6'758'500.00	0.15	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	6'000	0	0	6'000 CHF	92.40%	5'544'000.00	0.13	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	6'410	0	0	6'410 CHF	95.75%	6'137'575.00	0.14	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	1'200	0	0	1'200 CHF	97.85%	1'174'200.00	0.03	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	6'000	300	0	6'300 CHF	90.35%	5'692'050.00	0.13	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	3'000	0	0	3'000 CHF	90.10%	2'703'000.00	0.06	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	4'000	0	0	4'000 CHF	95.60%	3'824'000.00	0.09	a)
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	15'800	0	5'000	10'800 CHF	84.10%	9'082'800.00	0.21	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'800	0	0	3'800 CHF	85.35%	3'243'300.00	0.07	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKKB 0 11/05/29	15'000	0	0	15'000 CHF	95.45%	14'317'500.00	0.33	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	9'650	0	0	9'650 CHF	99.03%	9'556'395.00	0.22	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	16'500	0	4'360	12'140 CHF	98.77%	11'990'678.00	0.27	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	0	2'000	0	2'000 CHF	99.57%	1'991'400.00	0.05	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	0	3'000	0	3'000 CHF	99.70%	2'991'000.00	0.07	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'000	4'500	1'000	9'500 CHF	99.50%	9'452'500.00	0.22	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	13'200	3'000	0	16'200 CHF	102.80%	16'653'600.00	0.38	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	15'000	17'500	3'520	28'980 CHF	96.08%	27'843'984.00	0.64	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	15'875	0	1'500	14'375 CHF	93.09%	13'381'687.50	0.31	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	31'000	0	0	31'000 CHF	113.75%	35'262'500.00	0.81	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.02	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	7'250	0	0	7'250 CHF	100.75%	7'304'375.00	0.17	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	0	7'800	0	7'800 CHF	97.70%	7'620'600.00	0.17	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	3'000	2'600	0	5'600 CHF	92.80%	5'196'800.00	0.12	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	13'250	0	6'000	7'250 CHF	99.46%	7'210'850.00	0.17	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	97.90%	1'958'000.00	0.04	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	12'000	0	0	12'000 CHF	91.10%	10'932'000.00	0.25	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	1'000	2'000	1'000	2'000 CHF	94.70%	1'894'000.00	0.04	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	0	800	0	800 CHF	94.45%	755'600.00	0.02	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	0	4'900	0	4'900 CHF	94.52%	4'631'480.00	0.11	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	5'000	0	2'000	3'000 CHF	100.25%	3'007'500.00	0.07	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	6'000	2'000	1'000	7'000 CHF	96.90%	6'783'000.00	0.16	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	0	1'050	0	1'050 CHF	99.58%	1'045'590.00	0.02	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'500	0	0	6'500 CHF	96.99%	6'304'350.00	0.14	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	7'850	1'200	2'000	7'050 CHF	99.55%	7'018'275.00	0.16	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	6'000	1'000	5'000	2'000 CHF	95.45%	1'909'000.00	0.04	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	4'400	0	1'000	3'400 CHF	96.07%	3'266'380.00	0.07	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	0	2'000	0	2'000 CHF	91.85%	1'837'000.00	0.04	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	95.80%	2'203'400.00	0.05	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	2'000	0	0	2'000 CHF	98.05%	1'961'000.00	0.04	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	7'800	0	5'000	2'800 CHF	94.06%	2'633'680.00	0.06	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	13'310	0	8'000	5'310 CHF	77.80%	4'131'180.00	0.09	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	2'500	0	0	2'500 CHF	95.50%	2'387'500.00	0.05	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	2'575	1'570	0	4'145 CHF	98.30%	4'074'535.00	0.09	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	1'500	6'500	0	8'000 CHF	73.70%	5'896'000.00	0.14	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	4'000	3'000	4'000	3'000 CHF	95.60%	2'868'000.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	775	0	775	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	16'885	0	0	16'885 CHF	97.80%	16'513'530.00	0.38	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	9'000	2'000	0	11'000 CHF	95.25%	10'477'500.00	0.24	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	0	5'000	0	5'000 CHF	94.67%	4'733'500.00	0.11	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'400	0	0	2'400 CHF	85.80%	2'059'200.00	0.05	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	96.60%	4'830'000.00	0.11	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	7'000	2'000	7'000	2'000 CHF	95.20%	1'904'000.00	0.04	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	0	4'700	0	4'700 CHF	94.88%	4'459'360.00	0.10	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	5'000	2'700	0	7'700 CHF	91.00%	7'007'000.00	0.16	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	0	2'000	0	2'000 CHF	93.35%	1'867'000.00	0.04	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	7'400	0	0	7'400 CHF	99.31%	7'348'940.00	0.17	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	8'500	0	600	7'900 CHF	94.50%	7'465'500.00	0.17	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	2'800	0	0	2'800 CHF	92.70%	2'595'600.00	0.06	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	0	1'500	0	1'500 CHF	91.90%	1'378'500.00	0.03	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	0	600	0	600 CHF	92.25%	553'500.00	0.01	a)
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	1'500	0	0	1'500 CHF	94.00%	1'410'000.00	0.03	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	675	0	675	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	8'500	0	0	8'500 CHF	94.90%	8'066'500.00	0.18	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	3'000	7'000	4'000 CHF	98.60%	3'944'000.00	0.09	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	7'750	5'600	0	13'350 CHF	109.75%	14'651'625.00	0.34	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	0	11'000	1'000	10'000 CHF	110.45%	11'045'000.00	0.25	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	0	800	0	800 CHF	102.85%	822'800.00	0.02	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32	0	4'700	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	8'250	0	0	8'250 CHF	97.50%	8'043'750.00	0.18	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	31'950	0	0	31'950 CHF	80.63%	25'761'285.00	0.59	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	1'000	0	0	1'000 CHF	99.90%	999'000.00	0.02	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	9'820	0	9'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	2'800	0	0	2'800 CHF	94.48%	2'645'440.00	0.06	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	6'000	0	0	6'000 CHF	86.59%	5'195'400.00	0.12	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'400	0	0	2'400 CHF	92.20%	2'212'800.00	0.05	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	2'500	0	0	2'500 CHF	91.30%	2'282'500.00	0.05	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	1'800	0	1'800 CHF	97.95%	1'763'100.00	0.04	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	1'000	1'000	0	2'000 CHF	90.40%	1'808'000.00	0.04	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	500	2'000	0	2'500 CHF	92.19%	2'304'750.00	0.05	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.02%	1'000'200.00	0.02	a)
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	5'000	0	0	5'000 CHF	97.30%	4'865'000.00	0.11	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'500	0	0	1'500 CHF	93.55%	1'403'250.00	0.03	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	0	5'000	0	5'000 CHF	91.00%	4'550'000.00	0.10	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	3'140	0	0	3'140 CHF	99.59%	3'127'126.00	0.07	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	2'500	0	2'500 CHF	99.20%	2'480'000.00	0.06	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	4'500	7'600	0	12'100 CHF	97.80%	11'833'800.00	0.27	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	2'300	1'340	0	3'640 CHF	87.04%	3'168'256.00	0.07	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	3'565	1'200	0	4'765 CHF	99.56%	4'744'034.00	0.11	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'000	2'500	0	5'500 CHF	99.80%	5'489'000.00	0.13	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	0	800	0	800 CHF	88.25%	706'000.00	0.02	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	17'000	0	0	17'000 CHF	98.04%	16'666'800.00	0.38	a)
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	17'500	17'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	5'200	0	3'400	1'800 CHF	87.05%	1'566'900.00	0.04	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	6'000	0	0	6'000 CHF	95.60%	5'736'000.00	0.13	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	7'000	900	900	7'000 CHF	94.25%	6'597'500.00	0.15	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	32'750	0	0	32'750 CHF	95.70%	31'341'750.00	0.72	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	5'200	0	0	5'200 CHF	86.90%	4'518'800.00	0.10	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	0	2'800	0	2'800 CHF	97.70%	2'735'600.00	0.06	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	10'300	0	10'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	7'000	0	0	7'000 CHF	97.10%	6'797'000.00	0.16	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	24'000	2'000	0	26'000 CHF	96.00%	24'960'000.00	0.57	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	12'750	5'800	0	18'550 CHF	96.85%	17'965'675.00	0.41	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	500	5'700	5'500	700 CHF	97.55%	682'850.00	0.02	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'800	2'000	0	3'800 CHF	99.69%	3'788'220.00	0.09	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	24'300	0	1'500	22'800 CHF	96.65%	22'036'200.00	0.50	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	20'000	800	1'000	19'800 CHF	89.74%	17'768'520.00	0.41	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	92.00%	4'600'000.00	0.11	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	6'000	0	0	6'000 CHF	84.01%	5'040'600.00	0.12	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	10'000	1'500	1'000	10'500 CHF	95.43%	10'020'150.00	0.23	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	20'000	3'500	3'500	20'000 CHF	97.46%	19'492'000.00	0.45	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	0	5'750	0	5'750 CHF	94.60%	5'439'500.00	0.12	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	6'000	0	0	6'000 CHF	95.80%	5'748'000.00	0.13	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	9'500	0	0	9'500 CHF	92.26%	8'764'700.00	0.20	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	0	3'750	0	3'750 CHF	98.50%	3'693'750.00	0.08	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	6'600	5'000	0	11'600 CHF	96.65%	11'211'400.00	0.26	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVDX 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	94.40%	3'776'000.00	0.09	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	0	4'000	0	4'000 CHF	93.55%	3'742'000.00	0.09	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	5'000	2'100	900	6'200 CHF	94.25%	5'843'500.00	0.13	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	5'450	3'850	0	9'300 CHF	96.80%	9'002'400.00	0.21	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	0	3'200	0	3'200 CHF	93.90%	3'004'800.00	0.07	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	29'000	1'100	1'200	28'900 CHF	94.09%	27'192'010.00	0.62	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	0	800	0	800 CHF	89.50%	716'000.00	0.02	a)
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	1'650	0	0	1'650 CHF	99.80%	1'646'700.00	0.04	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	6'250	0	0	6'250 CHF	97.15%	6'071'875.00	0.14	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	0	6'200	0	6'200 CHF	87.33%	5'414'460.00	0.12	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	1'000	0	0	1'000 CHF	96.70%	967'000.00	0.02	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	1'500	0	0	1'500 CHF	95.10%	1'426'500.00	0.03	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	2'250	3'750	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	7'000	0	0	7'000 CHF	94.24%	6'596'800.00	0.15	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'600	0	0	2'600 CHF	88.90%	2'311'400.00	0.05	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'140	0	0	1'140 CHF	98.77%	1'125'978.00	0.03	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	10'000	0	0	10'000 CHF	94.50%	9'450'000.00	0.22	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	13'000	0	0	13'000 CHF	92.02%	11'962'600.00	0.27	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'650	0	0	1'650 CHF	98.92%	1'632'180.00	0.04	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	3'000	0	0	3'000 CHF	84.05%	2'521'500.00	0.06	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	8'000	0	1'000	7'000 CHF	92.95%	6'506'500.00	0.15	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	6'700	0	0	6'700 CHF	99.61%	6'673'870.00	0.15	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	5'000	0	5'000 CHF	98.15%	4'907'500.00	0.11	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	4'300	0	0	4'300 CHF	82.80%	3'560'400.00	0.08	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	33'500	5'000	1'200	37'300 CHF	95.55%	35'640'150.00	0.82	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	15'600	0	5'600	10'000 CHF	97.50%	9'750'000.00	0.22	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	13'000	0	1'000	12'000 CHF	95.07%	11'408'400.00	0.26	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	9'000	0	0	9'000 CHF	96.45%	8'680'500.00	0.20	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	9'700	0	0	9'700 CHF	95.93%	9'305'210.00	0.21	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	5'000	5'000	0	10'000 CHF	91.00%	9'100'000.00	0.21	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	10'000	0	1'000	9'000 CHF	98.93%	8'903'700.00	0.20	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	9'500	3'000	0	12'500 CHF	97.09%	12'136'250.00	0.28	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	0	11'200	0	11'200 CHF	92.70%	10'382'400.00	0.24	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	0	570	0	570 CHF	99.76%	568'632.00	0.01	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	2'650	0	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	500	5'100	2'250	3'350 CHF	99.50%	3'333'250.00	0.08	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'800	0	0	6'800 CHF	88.40%	6'011'200.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	9'000	0	0	9'000 CHF	97.95%	8'815'500.00	0.20	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	2'500	0	0	2'500 CHF	99.51%	2'487'750.00	0.06	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	8'000	0	2'875	5'125 CHF	99.80%	5'114'750.00	0.12	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	7'500	2'000	0	9'500 CHF	99.85%	9'485'750.00	0.22	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	6'720	0	0	6'720 CHF	106.85%	7'180'320.00	0.16	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	2'500	0	0	2'500 CHF	101.20%	2'530'000.00	0.06	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	20'000	0	1'000	19'000 CHF	101.10%	19'209'000.00	0.44	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	7'500	800	0	8'300 CHF	103.80%	8'615'400.00	0.20	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	500	5'000	0	5'500 CHF	106.79%	5'873'450.00	0.13	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	11'300	4'000	1'000	14'300 CHF	103.70%	14'829'100.00	0.34	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	2'600	0	2'600 CHF	100.90%	2'623'400.00	0.06	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	0	2'000	0	2'000 CHF	99.78%	1'995'600.00	0.05	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'875	0	0	1'875 CHF	99.80%	1'871'250.00	0.04	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	5'000	0	2'500	2'500 CHF	101.90%	2'547'500.00	0.06	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	5'300	4'000	0	9'300 CHF	102.35%	9'518'550.00	0.22	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	7'400	0	0	7'400 CHF	103.60%	7'666'400.00	0.18	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	14'950	7'500	1'000	21'450 CHF	102.25%	21'932'625.00	0.50	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	1'500	0	0	1'500 CHF	100.22%	1'503'300.00	0.03	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	4'500	0	0	4'500 CHF	99.93%	4'496'850.00	0.10	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	9'500	1'000	0	10'500 CHF	103.32%	10'848'600.00	0.25	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	25'500	3'500	2'500	26'500 CHF	114.12%	30'241'800.00	0.69	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	29'000	0	8'200	20'800 CHF	103.37%	21'500'960.00	0.49	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	12'000	0	1'000	11'000 CHF	105.96%	11'655'600.00	0.27	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	16'300	0	0	16'300 CHF	108.90%	17'750'700.00	0.41	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	10'000	1'000	0	11'000 CHF	102.65%	11'291'500.00	0.26	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	3'650	4'500	6'500	1'650 CHF	102.75%	1'695'375.00	0.04	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	14'600	12'000	0	26'600 CHF	105.01%	27'932'660.00	0.64	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	2'000	2'500	2'000 CHF	115.00%	2'300'000.00	0.05	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	5'100	0	0	5'100 CHF	104.20%	5'314'200.00	0.12	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	12'900	0	1'000	11'900 CHF	109.30%	13'006'700.00	0.30	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	0	5'000	1'600	3'400 CHF	109.58%	3'725'720.00	0.09	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	5'000	2'500	550	6'950 CHF	116.43%	8'091'885.00	0.19	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	10'700	4'000	0	14'700 CHF	131.65%	19'352'550.00	0.44	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	116.60%	2'915'000.00	0.07	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	7'370	0	0	7'370 CHF	124.20%	9'153'540.00	0.21	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	1'200	0	1'200 CHF	103.40%	1'240'800.00	0.03	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	9'700	0	0	9'700 CHF	110.82%	10'749'540.00	0.25	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	0	9'700	0	9'700 CHF	103.60%	10'049'200.00	0.23	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	4'000	2'000	0	6'000 CHF	105.30%	6'318'000.00	0.14	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	4'000	6'000 CHF	103.14%	6'188'400.00	0.14	a)
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	0	1'000	0	1'000 CHF	107.14%	1'071'400.00	0.02	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	10'000	0	4'300	5'700 CHF	111.90%	6'378'300.00	0.15	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	5'000	0	0	5'000 CHF	101.34%	5'067'000.00	0.12	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	1'000	800	0	1'800 CHF	116.40%	2'095'200.00	0.05	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	6'800	850	0	7'650 CHF	122.05%	9'336'825.00	0.21	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	0	1'000	0	1'000 CHF	103.15%	1'031'500.00	0.02	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	16'000	0	0	16'000 CHF	101.55%	16'248'000.00	0.37	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	2'750	0	0	2'750 CHF	106.95%	2'941'125.00	0.07	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	4'700	0	0	4'700 CHF	107.75%	5'064'250.00	0.12	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	2'500	3'000	0	5'500 CHF	109.97%	6'048'350.00	0.14	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	127.20%	6'360'000.00	0.15	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	5'000	0	0	5'000 CHF	104.60%	5'230'000.00	0.12	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	1'300	0	1'300 CHF	100.31%	1'304'030.00	0.03	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	3'000	800	1'250	2'550 CHF	109.28%	2'786'640.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	17'500	0	2'500	15'000 CHF	115.18%	17'277'000.00	0.40	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	3'500	1'500	0	5'000 CHF	114.05%	5'702'500.00	0.13	a)
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	2'000	0	0	2'000 CHF	101.91%	2'038'200.00	0.05	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	21'300	7'500	0	28'800 CHF	108.15%	31'147'200.00	0.71	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	5'000	0	0	5'000 CHF	106.05%	5'302'500.00	0.12	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	12'000	2'000	6'000	8'000 CHF	112.60%	9'008'000.00	0.21	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	10'150	0	3'000	7'150 CHF	108.13%	7'731'295.00	0.18	a)
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	0	2'000	0	2'000 CHF	111.16%	2'223'200.00	0.05	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	5'000	0	0	5'000 CHF	114.40%	5'720'000.00	0.13	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	2'200	0	0	2'200 CHF	106.20%	2'336'400.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	3'000	0	1'000	2'000 CHF	105.89%	2'117'800.00	0.05	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	15'460	0	0	15'460 CHF	111.28%	17'203'888.00	0.39	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	5'250	3'500	0	8'750 CHF	105.80%	9'257'500.00	0.21	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	12'000	0	5'500	6'500 CHF	107.80%	7'007'000.00	0.16	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	6'500	0	0	6'500 CHF	104.65%	6'802'250.00	0.16	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	2'500	1'000	1'200	2'300 CHF	104.80%	2'410'400.00	0.06	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	3'850	0	3'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	4'500	0	1'000	3'500 CHF	101.18%	3'541'300.00	0.08	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLIU 2 3/4 03/01/30	2'550	0	1'300	1'250 CHF	108.00%	1'350'000.00	0.03	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	0	3'000	0	3'000 CHF	106.27%	3'188'100.00	0.07	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	100.07%	3'002'100.00	0.07	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	5'500	0	2'000	3'500 CHF	107.62%	3'766'700.00	0.09	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	8'500	0	0	8'500 CHF	111.96%	9'516'600.00	0.22	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	1'500	0	0	1'500 CHF	101.04%	1'515'600.00	0.03	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	5'140	0	0	5'140 CHF	106.35%	5'466'390.00	0.13	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	5'000	0	5'000 CHF	103.40%	5'170'000.00	0.12	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	4'000	2'000	0	6'000 CHF	109.85%	6'591'000.00	0.15	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	32'500	8'000	0	40'500 CHF	112.58%	45'594'900.00	1.04	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	2'800	0	0	2'800 CHF	106.25%	2'975'000.00	0.07	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	2'500	0	2'500 CHF	114.25%	2'856'250.00	0.07	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	4'650	0	0	4'650 CHF	147.80%	6'872'700.00	0.16	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	10'800	0	1'250	9'550 CHF	106.45%	10'165'975.00	0.23	a)
CH1266847172	2.4000 % KENOVA 2.4 07/19/38	0	3'750	0	3'750 CHF	113.80%	4'267'500.00	0.10	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	6'000	0	0	6'000 CHF	106.30%	6'378'000.00	0.15	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	4'050	0	0	4'050 CHF	110.67%	4'482'135.00	0.10	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	3'500	0	0	3'500 CHF	110.85%	3'879'750.00	0.09	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	6'470	0	0	6'470 CHF	107.60%	6'961'720.00	0.16	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	2'770	0	0	2'770 CHF	103.55%	2'868'335.00	0.07	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	10'200	9'500	700 CHF	110.10%	770'700.00	0.02	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	1'250	0	0	1'250 CHF	114.81%	1'435'125.00	0.03	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	6'300	3'000	0	9'300 CHF	120.40%	11'197'200.00	0.26	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	11'700	0	0	11'700 CHF	109.48%	12'809'160.00	0.29	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	500	0	500 CHF	107.10%	535'500.00	0.01	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	3'200	0	3'200 CHF	113.01%	3'616'320.00	0.08	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	4'000	0	4'000 CHF	115.84%	4'633'600.00	0.11	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	21'000	600	0	21'600 CHF	106.85%	23'079'600.00	0.53	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	1'000	0	1'000 CHF	102.50%	1'025'000.00	0.02	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	5'000	1'250	0	6'250 CHF	104.65%	6'540'625.00	0.15	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	6'000	0	1'500	4'500 CHF	113.20%	5'094'000.00	0.12	a)
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	0	600	0	600 CHF	107.54%	645'240.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'500	0	2'500 CHF	110.70%	2'767'500.00	0.06	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	1'500	0	1'500 CHF	107.45%	1'611'750.00	0.04	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	4'500	0	0	4'500 CHF	104.60%	4'707'000.00	0.11	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	3'500	0	0	3'500 CHF	109.55%	3'834'250.00	0.09	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	6'375	0	6'375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	3'850	1'900	750	5'000 CHF	108.35%	5'417'500.00	0.12	a)
CH1290991327	1.1250 % KBBL 1 1/8 08/29/34	0	8'000	0	8'000 CHF	101.15%	8'092'000.00	0.19	a)
CH1291601958	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44 MAY	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	7'500	0	0	7'500 CHF	102.00%	7'650'000.00	0.18	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	5'000	0	3'800	1'200 CHF	104.65%	1'255'800.00	0.03	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	5'000	0	1'100	3'900 CHF	101.75%	3'968'250.00	0.09	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	5'000	4'000	0	9'000 CHF	108.90%	9'801'000.00	0.22	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	10'000	0	4'500	5'500 CHF	112.26%	6'174'300.00	0.14	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	5'000	0	5'000 CHF	104.35%	5'217'500.00	0.12	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	3'750	0	3'750 CHF	108.45%	4'066'875.00	0.09	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	500	0	500 CHF	111.35%	556'750.00	0.01	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	3'500	0	3'500 CHF	108.95%	3'813'250.00	0.09	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	3'000	0	3'000 CHF	101.50%	3'045'000.00	0.07	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	8'400	0	8'400 CHF	102.13%	8'578'920.00	0.20	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	17'500	0	17'500 CHF	103.71%	18'149'250.00	0.42	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	15'000	600	14'400 CHF	102.65%	14'781'600.00	0.34	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	8'335	0	8'335 CHF	108.40%	9'035'140.00	0.21	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1307121272	2.3750 % KWLLI 2 3/8 12/05/29	0	4'300	0	4'300 CHF	105.85%	4'551'550.00	0.10	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	12'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	8'500	0	8'500 CHF	108.55%	9'226'750.00	0.21	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	3'150	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	5'960	5'260	700 CHF	104.60%	732'200.00	0.02	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	0	700	0	700 CHF	104.02%	728'140.00	0.02	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	5'000	1'500	3'500 CHF	106.20%	3'717'000.00	0.09	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	2'000	0	2'000 CHF	102.75%	2'055'000.00	0.05	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	12'000	0	12'000 CHF	104.48%	12'537'600.00	0.29	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	7'300	0	7'300 CHF	105.75%	7'719'750.00	0.18	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	103.85%	2'077'000.00	0.05	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	8'000	0	8'000 CHF	106.25%	8'500'000.00	0.19	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	5'000	0	5'000 CHF	104.95%	5'247'500.00	0.12	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	4'100	0	4'100 CHF	103.65%	4'249'650.00	0.10	a)
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968629	1.4000 % PFZENT 1.4 03/15/38 591	0	3'000	0	3'000 CHF	104.99%	3'149'700.00	0.07	a)
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	0	8'000	0	8'000 CHF	105.00%	8'400'000.00	0.19	a)
CH1319968686	1.4500 % PFZENT 1.45 12/07/33 592	0	5'000	0	5'000 CHF	104.66%	5'233'000.00	0.12	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	1'100	0	1'100 CHF	101.50%	1'116'500.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	10'000	0	10'000 CHF	105.90%	10'590'000.00	0.24	a)
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	20'000	2'500	17'500 CHF	108.25%	18'943'750.00	0.43	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	5'000	0	5'000 CHF	101.30%	5'065'000.00	0.12	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	5'180	0	5'180 CHF	119.65%	6'197'870.00	0.14	a)
CH1340267090	1.3500 % KBAARG 1.35 04/30/31	0	5'850	0	5'850 CHF	102.55%	5'999'175.00	0.14	a)
CH1341034960	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/20/34 752	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341034978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/19/39 753	0	9'800	0	9'800 CHF	106.66%	10'452'680.00	0.24	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	7'650	2'550	5'100 CHF	102.45%	5'224'950.00	0.12	a)
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	2'250	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	0	2'000	0	2'000 CHF	103.85%	2'077'000.00	0.05	a)
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	0	7'100	0	7'100 CHF	106.30%	7'547'300.00	0.17	a)
CH1346742930	1.9000 % PGHNSW 1.9 06/07/30	0	6'300	0	6'300 CHF	103.95%	6'548'850.00	0.15	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	0	5'000	0	5'000 CHF	106.65%	5'332'500.00	0.12	a)
CH1346742989	1.4500 % PFZENT 1.45 08/02/34 594	0	1'000	0	1'000 CHF	104.82%	1'048'200.00	0.02	a)
CH1346742997	1.4500 % PFZENT 1.45 10/10/39 595	0	700	0	700 CHF	105.94%	741'580.00	0.02	a)
CH1346743011	1.8500 % WASSER 1.85 07/01/38	0	500	0	500 CHF	108.65%	543'250.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1346743029	2.0500 % MOBNSW 2.05 07/01/30	0	3'100	0	3'100 CHF	103.80%	3'217'800.00	0.07	a)
CH1346743052	1.3000 % ZURICH 1.3 06/24/37	0	3'600	0	3'600 CHF	106.20%	3'823'200.00	0.09	a)
CH1346743078	1.8500 % COOPSW 1.85 07/16/32	0	3'000	0	3'000 CHF	104.80%	3'144'000.00	0.07	a)
CH1346743094	1.6000 % BQTESS 1.6 07/10/36	0	20'000	0	20'000 CHF	105.65%	21'130'000.00	0.48	a)
CH1346743136	1.7000 % AMALEA 1.7 07/10/28	0	2'250	0	2'250 CHF	101.90%	2'292'750.00	0.05	a)
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	0	7'500	1'000	6'500 CHF	105.85%	6'880'250.00	0.16	a)
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	5'000	0	5'000 CHF	102.70%	5'135'000.00	0.12	a)
CH1348614194	1.3000 % ZURCTY 1.3 06/04/49	0	2'500	0	2'500 CHF	109.45%	2'736'250.00	0.06	a)
CH1348614202	1.5075 % UBS 1.5075 05/28/29	0	3'000	0	3'000 CHF	102.80%	3'084'000.00	0.07	a)
CH1349191804	1.6000 % BCG 1.6 06/10/30	0	1'000	0	1'000 CHF	102.90%	1'029'000.00	0.02	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	400	100	300 CHF	101.75%	305'250.00	0.01	a)
CH1349302930	0.9750 % ACANXB 0.975 04/23/29	0	8'100	0	8'100 CHF	100.15%	8'112'150.00	0.19	a)
CH1349643085	1.7000 % BCVAUD 1.7 06/04/38	0	500	0	500 CHF	106.30%	531'500.00	0.01	a)
CH1350727785	1.6500 % SCMN VX 1.65 08/23/30	0	5'000	0	5'000 CHF	103.75%	5'187'500.00	0.12	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMN VX 1.8 08/23/34	0	7'500	0	7'500 CHF	106.50%	7'987'500.00	0.18	a)
CH1353015006	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 08/10/28 756	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015022	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 07/24/37 757	0	800	0	800 CHF	104.40%	835'200.00	0.02	a)
CH1353015030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 758	0	800	0	800 CHF	104.68%	837'440.00	0.02	a)
CH1353015097	1.0600 % STGALL 1.06 10/30/51	0	5'000	0	5'000 CHF	99.65%	4'982'500.00	0.11	a)
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	9'400	6'500	2'900 CHF	104.75%	3'037'750.00	0.07	a)
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	12'000	0	12'000 CHF	107.00%	12'840'000.00	0.29	a)
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	12'000	0	12'000 CHF	111.10%	13'332'000.00	0.31	a)
CH1353257848	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/49	0	6'000	0	6'000 CHF	116.80%	7'008'000.00	0.16	a)
CH1353257863	1.9500 % HELNSW 1.95 06/26/34	0	6'800	0	6'800 CHF	106.10%	7'214'800.00	0.17	a)
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	5'000	0	5'000 CHF	100.80%	5'040'000.00	0.12	a)
CH1361401727	1.3000 % PFZENT 1.3 11/14/39 597	0	10'000	0	10'000 CHF	103.59%	10'359'000.00	0.24	a)
CH1361401842	1.1250 % ZKB 1 1/8 08/16/34 158	0	15'000	0	15'000 CHF	100.95%	15'142'500.00	0.35	a)
CH1366517105	1.1300 % THURBK 1.13 08/29/44	0	400	0	400 CHF	101.55%	406'200.00	0.01	a)
CH1371736740	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 AUG	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1371736757	1.0000 % PSHYPO 1 06/07/33 759	0	2'000	0	2'000 CHF	100.74%	2'014'800.00	0.05	a)
CH1371736765	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 12/23/39 760	0	3'500	0	3'500 CHF	101.60%	3'556'000.00	0.08	a)
CH1371736807	0.9850 % ROSW 0.985 09/06/29	0	10'000	0	10'000 CHF	100.80%	10'080'000.00	0.23	a)
CH1371736815	1.0975 % ROSW 1.0975 09/06/34	0	10'000	0	10'000 CHF	100.90%	10'090'000.00	0.23	a)
CH1371736823	1.1700 % ROSW 1.17 09/06/39	0	11'750	0	11'750 CHF	101.10%	11'879'250.00	0.27	a)
CH1373904270	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/08/34	0	3'500	0	3'500 CHF	100.25%	3'508'750.00	0.08	a)
CH1373904288	0.8500 % ZURCTY 0.85 09/09/50	0	5'000	0	5'000 CHF	99.75%	4'987'500.00	0.11	a)
CH1373904429	1.5000 % UNIZUE 1 1/2 09/27/32	0	2'000	0	2'000 CHF	101.70%	2'034'000.00	0.05	a)
CH1373904437	1.6500 % UNIZUE 1.65 09/26/36	0	4'000	0	4'000 CHF	102.25%	4'090'000.00	0.09	a)
CH1373904445	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 SEP	0	7'500	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1373904478	1.6000 % KSGRAU 1.6 09/27/34	0	5'000	0	5'000 CHF	101.70%	5'085'000.00	0.12	a)
CH1373904486	0.8500 % ZURICH 0.85 09/24/36	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.12	a)
CH1373904494	1.3500 % COOPSW 1.35 09/27/30	0	8'000	0	8'000 CHF	101.40%	8'112'000.00	0.19	a)
CH1373904502	1.6500 % COOPSW 1.65 09/27/34	0	4'000	0	4'000 CHF	102.55%	4'102'000.00	0.09	a)
CH1373904510	1.6000 % KWLILU 1.6 10/15/32	0	5'500	0	5'500 CHF	101.90%	5'604'500.00	0.13	a)
CH1373904536	1.0000 % WINCTY 1 09/29/51	0	4'500	0	4'500 CHF	101.20%	4'554'000.00	0.10	a)
CH1380011192	1.5000 % BKWSW 1 1/2 10/18/34	0	5'000	0	5'000 CHF	102.10%	5'105'000.00	0.12	a)
CH1380011309	1.6000 % EMMI 1.6 10/30/34	0	4'000	0	4'000 CHF	101.65%	4'066'000.00	0.09	a)
CH1380011374	1.7750 % PLAN SW 1.775 11/27/29	0	3'000	0	3'000 CHF	100.50%	3'015'090.00	0.07	a)
CH1380910260	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 11/10/64	0	5'000	0	5'000 CHF	106.72%	5'336'000.00	0.12	a)
CH1380910302	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 OCT	0	40'000	0	40'000 CHF	105.89%	42'354'800.00	0.97	a)
CH1380910328	1.3750 % ACLNSW 1 3/8 11/14/30	0	2'130	0	2'130 CHF	100.38%	2'138'008.80	0.05	a)
CH1380910351	0.9000 % BERCTY 0.9 11/01/33	0	5'000	0	5'000 CHF	99.90%	4'995'000.00	0.11	a)
CH1380910369	1.1250 % BERCTY 1 1/8 11/01/44	0	5'000	0	5'000 CHF	102.20%	5'110'000.00	0.12	a)
CH1380910377	1.5000 % ISHZ 1 1/2 11/08/29	0	2'000	0	2'000 CHF	100.19%	2'003'840.00	0.05	a)
CH1388731346	0.9000 % TESSIN 0.9 10/14/55	0	8'000	0	8'000 CHF	102.30%	8'184'000.00	0.19	a)
CH1395330082	1.1300 % THURBK 1.13 08/29/44 NOV	0	7'500	0	7'500 CHF	101.44%	7'607'925.00	0.17	a)
CH							3'120'651'865.80	71.51	
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	0	4'200	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.40%	1'888'000.00	0.04	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	3'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	97.70%	2'735'600.00	0.06	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	98.05%	5'883'000.00	0.13	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	6'600	500	0	7'100 CHF	98.45%	6'989'950.00	0.16	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	8'000	0	3'500	4'500 CHF	98.20%	4'419'000.00	0.10	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	400	50	350 CHF	103.95%	363'825.00	0.01	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	9'000	0	9'000 CHF	102.40%	9'216'000.00	0.21	a)
CL							31'495'375.00	0.72	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	10'550	0	10'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	6'700	0	0	6'700 CHF	97.75%	6'549'250.00	0.15	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	1'300	1'300	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	2'530	0	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.85%	1'937'000.00	0.04	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	0	765	0	765 CHF	95.90%	733'635.00	0.02	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	97.60%	9'174'400.00	0.21	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	94.25%	7'540'000.00	0.17	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	13'000	2'350	0	15'350 CHF	96.70%	14'843'450.00	0.34	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	97.25%	9'141'500.00	0.21	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	10'750	0	0	10'750 CHF	89.45%	9'615'875.00	0.22	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	6'200	0	0	6'200 CHF	97.55%	6'048'100.00	0.14	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	7'500	0	4'000	3'500 CHF	95.95%	3'358'250.00	0.08	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	0	400	0	400 CHF	95.80%	383'200.00	0.01	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	108.50%	10'850'000.00	0.25	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	5'000	0	4'600	400 CHF	106.45%	425'800.00	0.01	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	5'000	0	1'000	4'000 CHF	101.55%	4'062'000.00	0.09	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	109.15%	4'366'000.00	0.10	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.90%	1'039'000.00	0.02	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.95%	5'247'500.00	0.12	a)
CH1341035025	1.7500 % BHH 1 3/4 05/08/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	102.10%	2'552'500.00	0.06	a)
CH1356570320	1.9875 % CMZB 1.9875 09/09/31	0	4'500	0	4'500 CHF	102.10%	4'594'500.00	0.11	a)
CH1357852750	1.5100 % BHH 1.51 07/31/30 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	102.00%	6'120'000.00	0.14	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.20%	5'110'000.00	0.12	a)
CH1380508411	2.0725 % DB 2.0725 09/18/30 EMTN	0	11'600	0	11'600 CHF	101.65%	11'791'400.00	0.27	a)
CH1391392466	1.6000 % MUNHYP 1.6 11/05/29 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	99.80%	2'395'200.00	0.05	a)
DE							127'878'560.00	2.93	
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	85.20%	4'260'000.00	0.10	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	105.15%	10'515'000.00	0.24	a)
DK							14'775'000.00	0.34	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'300	1'900	0	3'200 CHF	99.97%	3'199'040.00	0.07	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'500	4'000	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'400	400	0	2'800 CHF	98.45%	2'756'600.00	0.06	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	9'900	0	9'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	98.55%	2'759'400.00	0.06	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	101.68%	7'117'600.00	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.55%	5'077'500.00	0.12	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	9'500	0	500	9'000 CHF	105.80%	9'522'000.00	0.22	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	104.40%	4'176'000.00	0.10	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	17'000	0	17'000 CHF	106.95%	18'181'500.00	0.42	a)
CH1357852685	1.5625 % IBESM 1.5625 07/11/31 EMTN	0	4'700	0	4'700 CHF	102.80%	4'831'600.00	0.11	a)
CH1359203382	2.3450 % SANTAN 2.345 07/03/31 EMTN	0	300	0	300 CHF	104.65%	313'950.00	0.01	a)
ES							57'935'190.00	1.33	
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.30%	5'115'000.00	0.12	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	103.35%	10'335'000.00	0.24	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	11'000	0	1'000	10'000 CHF	105.10%	10'510'000.00	0.24	a)
FI							25'960'000.00	0.59	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	13'525	0	1'000	12'525 CHF	101.74%	12'742'935.00	0.29	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	9'440	0	9'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	9'200	0	9'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.25%	992'500.00	0.02	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	99.05%	6'933'500.00	0.16	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	99.87%	5'992'200.00	0.14	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	0	2'500	1'500	1'000 CHF	99.91%	999'100.00	0.02	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.95%	1'979'000.00	0.05	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.65%	1'973'000.00	0.05	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	97.35%	6'814'500.00	0.16	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.85%	988'500.00	0.02	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	97.20%	2'527'200.00	0.06	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	3'000	5'000	3'000	5'000 CHF	96.10%	4'805'000.00	0.11	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.85%	988'500.00	0.02	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	4'800	0	2'000	2'800 CHF	96.40%	2'699'200.00	0.06	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	3'000	2'000	0	5'000 CHF	96.20%	4'810'000.00	0.11	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	97.50%	7'800'000.00	0.18	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	8'800	0	0	8'800 CHF	97.65%	8'593'200.00	0.20	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	5'400	0	2'400	3'000 CHF	107.40%	3'222'000.00	0.07	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	10'500	4'600	0	15'100 CHF	97.15%	14'669'650.00	0.34	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	3'000	400	3'000	400 CHF	96.85%	387'400.00	0.01	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	1'260	0	1'260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	4'000	0	1'000	3'000 CHF	97.05%	2'911'500.00	0.07	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	9'000	0	2'250	6'750 CHF	100.40%	6'777'000.00	0.16	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	4'500	0	0	4'500 CHF	103.60%	4'662'000.00	0.11	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	3'800	4'000	0	7'800 CHF	102.85%	8'022'300.00	0.18	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	10'000	0	4'000	6'000 CHF	106.50%	6'390'000.00	0.15	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	6'000	0	5'000	1'000 CHF	101.83%	1'018'300.00	0.02	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	0	4'000	2'500	1'500 CHF	106.90%	1'603'500.00	0.04	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	104.05%	2'601'250.00	0.06	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 CHF	103.75%	3'112'500.00	0.07	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	107.90%	10'790'000.00	0.25	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	107.95%	1'079'500.00	0.02	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	10'000	0	2'000	8'000 CHF	104.30%	8'344'000.00	0.19	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	5'000	3'000	0	8'000 CHF	106.85%	8'548'000.00	0.20	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	10'000	0	1'000	9'000 CHF	107.85%	9'706'500.00	0.22	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	105.80%	5'290'000.00	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	10'000	2'000	8'000 CHF	105.00%	8'400'000.00	0.19	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	106.15%	4'246'000.00	0.10	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	9'000	0	9'000 CHF	104.85%	9'436'500.00	0.22	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 CHF	104.90%	3'147'000.00	0.07	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	7'500	0	7'500 CHF	106.45%	7'983'750.00	0.18	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	5'400	0	5'400 CHF	103.55%	5'591'700.00	0.13	a)
CH1321508330	1.5000 % CDCEPS 1 1/2 05/24/39 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	106.65%	2'133'000.00	0.05	a)
CH1321508363	1.5650 % EDF 1.565 09/06/29 EMTN	0	300	0	300 CHF	101.50%	304'500.00	0.01	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.55%	5'227'500.00	0.12	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.75%	5'137'500.00	0.12	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	2'600	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	103.95%	5'197'500.00	0.12	a)
CH1356570312	1.7425 % EDF 1.7425 09/06/32 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.95%	10'195'000.00	0.23	a)
CH1377443853	1.6700 % ACAFP 1.67 09/26/29 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.50%	10'150'000.00	0.23	a)
FR							247'923'685.00	5.68	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.94%	999'400.00	0.02	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	6'150	0	6'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	12'000	4'400	0	16'400 CHF	97.85%	16'047'400.00	0.37	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	16'200	0	0	16'200 CHF	97.90%	15'859'800.00	0.36	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	5'000	400	5'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	0	2'300	0	2'300 CHF	99.90%	2'297'700.00	0.05	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'600	1'000	0	2'600 CHF	100.45%	2'611'700.00	0.06	a)
CH1202242223	1.5203 % NWISE 1.5203 12/17/29	0	1'000	0	1'000 CHF	103.55%	1'035'500.00	0.02	a)
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.20%	2'044'000.00	0.05	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	2'600	1'000	0	3'600 CHF	106.10%	3'819'600.00	0.09	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	103.05%	3'091'500.00	0.07	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	4'000	0	3'200	800 CHF	102.15%	817'200.00	0.02	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	5'000	5'400	0	10'400 CHF	105.65%	10'987'600.00	0.25	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	102.80%	7'196'000.00	0.16	a)
CH1356570338	1.5350 % BPLN 1.535 09/30/31 EMTN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1357852818	1.4450 % NWG 1.445 08/27/29 EMTN	0	7'600	0	7'600 CHF	101.40%	7'706'400.00	0.18	a)
GB							74'513'800.00	1.71	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	8'400	0	8'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
IE							0.00	0.00	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
JE							0.00	0.00	
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	3'000	2'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	17'000	0	0	17'000 CHF	100.10%	17'017'000.00	0.39	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	5'000	0	0	5'000 CHF	101.21%	5'060'500.00	0.12	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	0	1'000	0	1'000 CHF	104.65%	1'046'500.00	0.02	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	4'545	0	4'545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	4'300	1'000	3'300 CHF	104.85%	3'460'050.00	0.08	a)
KR							26'584'050.00	0.61	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	4'600	1'150	5'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'500	0	0	1'500 CHF	94.30%	1'414'500.00	0.03	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	5'000	0	5'000 CHF	105.65%	5'282'500.00	0.12	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LI							6'697'000.00	0.15	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.05%	5'202'500.00	0.12	a)
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	4'315	4'315	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LU							5'202'500.00	0.12	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	5'350	1'000	0	6'350 CHF	104.20%	6'616'700.00	0.15	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	106.90%	2'138'000.00	0.05	a)
CH0315593860	0.3000 % ABNANV 0.3 12/18/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	7'750	0	7'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	97.75%	3'519'000.00	0.08	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	97.90%	2'545'400.00	0.06	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	88.00%	4'400'000.00	0.10	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	10'000	0	1'000	9'000 CHF	97.75%	8'797'500.00	0.20	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	2'000	0	2'000 CHF	95.60%	1'912'000.00	0.04	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.40%	2'008'000.00	0.05	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	104.40%	5'220'000.00	0.12	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	2'725	905	3'630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	5'000	7'000	1'800	10'200 CHF	105.00%	10'710'000.00	0.25	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	102.00%	4'080'000.00	0.09	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	9'810	1'000	8'810 CHF	102.75%	9'052'275.00	0.21	a)
CH1353257749	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 EMTN	0	11'500	0	11'500 CHF	107.00%	12'305'000.00	0.28	a)
CH1376931536	1.2000 % BMW 1.2 10/09/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.45%	5'022'500.00	0.12	a)
CH1380011226	1.3175 % BNG 1.3175 06/07/39 OCT	0	7'500	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
NL							78'326'375.00	1.79	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	8'300	0	0	8'300 CHF	100.30%	8'324'900.00	0.19	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	5'000	2'000	5'000	2'000 CHF	102.00%	2'040'000.00	0.05	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	8'600	0	200	8'400 CHF	104.75%	8'799'000.00	0.20	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	105.70%	5'285'000.00	0.12	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	103.00%	4'120'000.00	0.09	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.25%	5'212'500.00	0.12	a)
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	103.10%	10'310'000.00	0.24	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.60%	5'130'000.00	0.12	a)
NO							49'221'400.00	1.13	
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	3'000	6'000	0	9'000 CHF	97.05%	8'734'500.00	0.20	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	3'950	0	0	3'950 CHF	96.60%	3'815'700.00	0.09	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	450	4'000	450	4'000 CHF	97.00%	3'880'000.00	0.09	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	3'750	0	0	3'750 CHF	105.90%	3'971'250.00	0.09	a)
NZ							20'401'450.00	0.47	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	6'500	0	0	6'500 CHF	97.70%	6'350'500.00	0.15	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'000	0	0	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	0.02	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	109.35%	4'374'000.00	0.10	a)
SE							11'715'000.00	0.27	
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28 4Y	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34 10Y	0	10'500	0	10'500 CHF	105.45%	11'072'250.00	0.25	a)
SK							11'072'250.00	0.25	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	8'010	2'000	5'010	5'000 CHF	99.96%	4'998'000.00	0.11	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	100.09%	4'003'600.00	0.09	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	8'000	3'500	11'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	99.00%	7'920'000.00	0.18	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'250	4'000	0	5'250 CHF	98.05%	5'147'625.00	0.12	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	8'800	13'000	0	21'800 CHF	97.95%	21'353'100.00	0.49	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	10'000	2'000	3'000	9'000 CHF	95.60%	8'604'000.00	0.20	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	0	5'400	2'500	2'900 CHF	96.25%	2'791'250.00	0.06	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'000	5'400	2'000	6'400 CHF	96.55%	6'179'200.00	0.14	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	6'500	0	0	6'500 CHF	96.25%	6'256'250.00	0.14	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	96.70%	1'160'400.00	0.03	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'400	7'000	0	10'400 CHF	97.00%	10'088'000.00	0.23	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	3'000	0	3'000 CHF	105.95%	3'178'500.00	0.07	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	10'000	3'000	7'000 CHF	104.50%	7'315'000.00	0.17	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	10'000	500	9'500 CHF	107.55%	10'217'250.00	0.23	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	1'250	0	1'250 CHF	101.05%	1'263'125.00	0.03	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	19'000	2'000	17'000 CHF	105.25%	17'892'500.00	0.41	a)
US							118'367'800.00	2.71	
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	0	2'000	0	2'000 CHF	111.05%	2'221'000.00	0.05	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	6'600	0	2'500	4'100 CHF	103.55%	4'245'550.00	0.10	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	0	400	0	400 CHF	102.65%	410'600.00	0.01	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	0	7'000	2'000	5'000 CHF	99.32%	4'966'000.00	0.11	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	4'000	2'200	0	6'200 CHF	96.70%	5'995'400.00	0.14	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	2'000	0	0	2'000 CHF	97.70%	1'954'000.00	0.04	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	3'050	0	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	6'000	7'000	0	13'000 CHF	96.95%	12'603'500.00	0.29	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	4'015	400	4'415	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'500	0	500	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.02	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	1'000	1'500	0	2'500 CHF	91.40%	2'285'000.00	0.05	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'200	500	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	95.95%	4'797'500.00	0.11	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	94.25%	6'597'500.00	0.15	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	98.50%	3'152'000.00	0.07	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.00%	5'150'000.00	0.12	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	105.29%	3'158'700.00	0.07	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	4'000	0	0	4'000 CHF	103.40%	4'136'000.00	0.09	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.55%	5'227'500.00	0.12	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	1'500	0	1'500 CHF	102.35%	1'535'250.00	0.04	a)
CH1353258168	1.1575 % IBRD 1.1575 06/11/31 EMTN	0	4'950	0	4'950 CHF	103.40%	5'118'300.00	0.12	a)
XS							74'535'300.00	1.71	

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

0.00 0.00

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

0.00 0.00

CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	0	460'020	460'020	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	0	129'520	129'520	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

CH 0.00 0.00

Derivative Finanzinstrumente

-8'537'007.27 -0.20

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Swaps							-8'537'007.27	-0.20	
06/32	IRS FIX LEG 1.2925% P.A. CHF	0	0	40'000	-40'000 CHF	106.16%	-42'463'327.93	-0.97	b)
06/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	40'000	0	40'000 CHF	100.00	40'000'000.00	0.92	b)
08/32	IRS FIX LEG 1.8375% P.A. CHF	-30'000	30'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	30'000	0	30'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	-15'000	15'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	-20'000	20'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	20'000	0	20'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/34	IRS FIX LEG 1.2675% P.A. CHF	0	0	50'000	-50'000 CHF	106.97%	-53'485'167.96	-1.23	b)
06/34	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	50'000	0	50'000 CHF	100.00	50'000'000.00	1.15	b)
06/36	IRS FIX LEG 1.31% P.A. CHF	0	0	25'000	-25'000 CHF	108.36%	-27'090'875.59	-0.62	b)
06/36	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	25'000	0	25'000 CHF	100.00	25'000'000.00	0.57	b)
10/36	IRS FIX LEG 0.6725% P.A. CHF	0	0	40'000	-40'000 CHF	100.97%	-40'386'022.47	-0.93	b)
10/36	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	40'000	0	40'000 CHF	100.00	40'000'000.00	0.92	b)
10/44	IRS FIX LEG 0.7425% P.A. CHF	0	0	5'000	-5'000 CHF	102.23%	-5'111'613.32	-0.12	b)
10/44	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	5'000	0	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.11	b)

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	8'200'000.32	0.19
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'336'013'115.80	99.36
Derivative Finanzinstrumente	-8'537'007.27	-0.20
Sonstige Vermögenswerte	28'311'765.63	0.65
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'363'987'874.48	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-15'193'230.06	
Andere Verbindlichkeiten	-245'331.52	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'348'549'312.90	

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);	4'336'013'115.80	99.36
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-8'537'007.27	-0.20
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts	Kurswert CHF	in % 7)
OTC COLLATERAL IV-BFCHFA CHF ZKB	8'200'000	0.19

OTC Gegenparteien
Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse
USD 1 = CHF 0.86470000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	168'537'007.27	3.876

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

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	0.750	1.200	0.550	0.200	2.000
BA CHF	0.480	0.900	0.280	0.200	2.000
CT CHF	0.450	0.750	0.250	0.200	2.000
DT CHF	0.350	0.700	0.250	0.100	2.000
GT CHF	0.280	0.600	0.180	0.100	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Swiss Bond Index (SBI)® AAA-BBB Total Return

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.30000	0.10500	0.19500
BA CHF	Nein	CHF	0.65000	0.22750	0.42250

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.59993	0.20997	0.38996
DT CHF	Nein	CHF	7.597	2.658	4.939
GT CHF	Nein	CHF	0.77039	0.26963	0.50076
MT CHF	Nein	CHF	1.004	0.351	0.653
NT CHF	Nein	CHF	15.041	5.264	9.777

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

7 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Übersicht

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022	01.11.2020 31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		549'321'309.10	499'908'675.74	360'139'579.40	425'116'466.88
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		28'723'620.38	32'362'439.83	41'161'222.89	56'869'758.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		374'182.711	429'090.159	493'320.812	573'164.927
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		76.7636	75.4211	83.4370	99.2206
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		76.8020	75.4512	83.4370	99.2702
Ausschüttung je Anteil		0.65	0.10	0.15	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'404'808.70	15'968'691.77	20'067'069.68	27'588'771.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		166'001.678	202'061.142	230'600.732	268'867.916
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.7510	79.0290	87.0208	102.6109
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		80.7914	79.0606	87.0208	102.6622
Thesaurierung je Anteil		1.07	0.45	0.43	1.27
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		178'932'237.52	177'376'234.98	120'578'093.61	208'682'159.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		153'365.676	155'832.278	96'489.200	142'066.990
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'166.7033	1'138.2509	1'249.6538	1'468.8997
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'167.2866	1'138.7062	1'249.6538	1'469.6342
Thesaurierung je Anteil		21.29	12.50	12.90	25.58
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		18'829'547.04	12'974'305.02		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		218'195.343	154'239.560		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.7996	92.4322		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.8495	92.4691		
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		1.57	0.70		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %		
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		309'431'095.46	261'227'004.14	178'333'193.22	131'975'778.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'619'730.538	3'175'843.948	2'080'435.249	1'341'135.464
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.4846	82.2544	85.7192	98.4060
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		85.5273	82.2873	85.7192	98.4552
Thesaurierung je Anteil		1.54	0.89	0.86	1.71
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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	1.92 %	-6.09 %	-16.47 %	-2.69 %
Klasse CT CHF	2.39 %	-5.66 %	-16.09 %	-2.25 %
Klasse NT CHF	2.89 %	-5.09 %	-15.74 %	-1.76 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	8.28 %	1.46 %	-	-
Klasse NTH1 CHF	4.31 %	1.88 %	-12.77 %	-3.07 %
Benchmark Hedge	4.00 %	2.16 %	-13.39 %	-
Benchmark	2.53 %	-5.23 %	-16.47 %	-2.44 %
Tracking Error 33)	0.56 %	0.35 %	0.65 %	0.53 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse AA CHF	-0.61 %
Klasse CT CHF	-0.14 %
Klasse NT CHF	0.36 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	5.75 %
Klasse NTH1 CHF	0.31 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	5'417'282.46	13'436'822.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	557'489'123.47	528'371'785.30
Derivative Finanzinstrumente	-21'898.29	-1'972'510.85
Sonstige Vermögenswerte	3'378'469.40	2'863'606.13
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	566'262'977.04	542'699'702.94
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-16'912'600.92	-42'757'008.38
Andere Verbindlichkeiten	-29'067.02	-34'018.82
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	549'321'309.10	499'908'675.74

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		429'090.159	493'320.812
Ausgegebene Anteile		3'555.301	3'219.711
Zurückgenommene Anteile		-58'462.749	-67'450.364
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		374'182.711	429'090.159

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		202'061.142	230'600.732
Ausgegebene Anteile		3'258.693	1'752.811
Zurückgenommene Anteile		-39'318.157	-30'292.401
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		166'001.678	202'061.142

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		155'832.278	96'489.200
Ausgegebene Anteile		56'704.064	83'991.805
Zurückgenommene Anteile		-59'170.666	-24'648.727
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		153'365.676	155'832.278

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 27.03.2023 31.10.2023
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		154'239.560	-
Ausgegebene Anteile		84'356.841	154'339.560
Zurückgenommene Anteile		-20'401.058	-100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		218'195.343	154'239.560

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'175'843.948	2'080'435.249
Ausgegebene Anteile		2'864'203.988	1'942'490.559
Zurückgenommene Anteile		-2'285'504.074	-847'081.860
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-134'813.324	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'619'730.538	3'175'843.948

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	30.08.2024	11'657'011.54	134'813.324

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		499'908'675.74	360'139'579.40
Ausbezahlte Ausschüttung		-42'008.42	-71'592.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'858'186.60	-1'276'146.46
Saldo aus dem Anteilverkehr		30'595'441.01	168'697'998.87
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		20'717'387.37	-27'581'163.67
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		549'321'309.10	499'908'675.74

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		93'257.43	77'151.67
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-3'628.02	-19'203.46
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		10'526'444.47	4'486'578.42
Erträge aus Wertpapierleihe		89'133.30	77'174.24
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'113'370.66	1'264'191.02
Total Ertrag		12'818'577.84	5'885'891.89
Aufwand			
Passivzinsen		-3.11	0.00
Reglementarische Vergütungen		-368'975.60	-442'597.71
Sonstige Aufwendungen		-336.00	-504.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'806'824.04	-424'936.08
Total Aufwand		-3'176'138.75	-868'037.79
Nettoertrag / Verlust		9'642'439.09	5'017'854.10
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-14'288'162.71	-16'803'003.48
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		181'349.91	186'975.26
Realisierter Erfolg		-4'464'373.71	-11'598'174.12
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		25'181'761.08	-15'982'989.55
Gesamterfolg		20'717'387.37	-27'581'163.67

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	249'539.69	27'603.34
Vortrag des Vorjahres	7'418.05	22'723.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	256'957.74	50'327.07
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	243'218.76	42'909.02
Vortrag auf neue Rechnung	13'738.98	7'418.05
Total	256'957.74	50'327.07
Klasse CT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	178'861.61	92'840.05
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	178'861.61	92'840.05
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	62'601.56	32'494.02
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	116'260.05	60'346.03
Total	178'861.61	92'840.05
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	3'265'690.83	1'948'247.13
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'265'690.83	1'948'247.13
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'142'991.79	681'886.50
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'122'699.04	1'266'360.63
Total	3'265'690.83	1'948'247.13
Klasse NT USD	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	343'572.28	109'003.88
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	343'572.28	109'003.88
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	120'250.30	38'151.36
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	223'321.98	70'852.52
Total	343'572.28	109'003.88
Klasse NTH1 CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	5'604'774.68	2'840'159.70
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'604'774.68	2'840'159.70
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'961'671.14	994'055.90
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'643'103.54	1'846'103.80
Total	5'604'774.68	2'840'159.70

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							557'489'123.47	98.45	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							557'489'123.47	98.45	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	100.98%	1'224'981.07	0.22	a)
AE							1'224'981.07	0.22	
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	0	3'000	150	2'850 EUR	91.91%	2'458'963.81	0.43	a)
AT							2'458'963.81	0.43	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	4'000	0	1'250	2'750 AUD	76.79%	1'195'957.76	0.21	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	2'800	2'400	4'400	800 AUD	99.81%	452'223.78	0.08	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'100	0	0	1'100 AUD	52.62%	327'831.20	0.06	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	1'250	1'250	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	0	2'750	1'200	1'550 AUD	82.10%	720'780.08	0.13	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	5'500	0	400	5'100 AUD	71.99%	2'079'424.11	0.37	a)
USQ97417FA49	1.5520 % WSTP 1.552 09/30/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	94.68%	1'637'378.63	0.29	a)
XS2673140633	3.7680 % CBAAU 3.768 08/31/27	4'000	0	2'000	2'000 EUR	102.91%	1'932'209.42	0.34	a)
AU							8'345'804.98	1.47	
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	4'500	4'500	6'750	2'250 EUR	62.84%	1'327'247.52	0.23	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	12'000	9'000	3'000 EUR	98.96%	2'787'099.39	0.49	a)
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	8'500	3'500	5'000 USD	98.39%	4'253'848.42	0.75	a)
BE							8'368'195.33	1.48	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	1'750	0	0	1'750 CAD	76.01%	825'128.01	0.15	a)
CA110709GL02	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/32	2'000	2'000	500	3'500 CAD	96.92%	2'104'218.09	0.37	a)
CA12593ZAA80	3.9500 % CPPIBC 3.95 06/02/32	4'000	0	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	2'100	0	2'100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	6'750	2'750	4'000 CAD	85.82%	2'129'545.90	0.38	a)
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	0	2'250	0	2'250 CAD	89.60%	1'250'530.38	0.22	a)
CA135087N423	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/24	1'800	0	1'800	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	0	750	0	750 CAD	95.16%	442'715.61	0.08	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	4'750	3'250	8'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZBH97	4.1000 % ONT 4.1 10/07/54	0	1'750	0	1'750 CAD	98.80%	1'072'485.12	0.19	a)
US22411WAR79	0.5000 % CPPIBC 0 1/2 09/16/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BKB70	4.3750 % EDC 4 3/8 06/29/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BKF84	4.7500 % EDC 4 3/4 06/05/34	0	2'350	2'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US891160TD51	4.7010 % TD 4.701 06/05/26 144A	0	5'000	200	4'800 USD	100.30%	4'162'928.67	0.74	a)
USC23264AF80	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AK75	0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 REGS	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AX96	4.8750 % CADEPO 4 7/8 06/05/29 REGS	0	4'450	0	4'450 USD	101.87%	3'919'986.45	0.69	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	5'500	0	2'000	3'500 USD	94.64%	2'864'080.96	0.51	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	7'000	4'000	3'000 USD	104.96%	2'722'767.36	0.48	a)
USC7976PAK24	4.8510 % RY 4.851 12/14/26 REGS	0	5'000	1'000	4'000 USD	100.81%	3'486'747.10	0.62	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2250201329	0.0000 % Q 0 10/29/30 EMTN	0	6'200	200	6'000 EUR	84.69%	4'769'926.68	0.84	a)
XS2305736543	0.0500 % CPPIBC 0.05 02/24/31 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	84.04%	1'972'425.84	0.35	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN	2'000	0	100	1'900 EUR	57.77%	1'030'409.68	0.18	a)
XS2448412879	0.5000 % EDC 0 1/2 02/25/27 EMTN	2'000	3'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	4'000	0	100	3'900 EUR	92.19%	3'375'222.31	0.60	a)
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	1'500	1'500	3'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	7'000	0	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2850686655	3.2500 % PSPCAP 3 1/4 07/02/34 REGS	0	2'800	0	2'800 EUR	101.55%	2'669'318.97	0.47	a)
XS2865588797	3.3500 % Q 3.35 07/23/39 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2895482201	2.8620 % TD 2.862 04/15/31	0	7'200	1'200	6'000 EUR	100.31%	5'650'181.91	1.00	a)
CA							44'448'619.04	7.85	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	750	1'000	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	3'750	2'500	1'250 CHF	99.69%	1'246'125.00	0.22	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	750	250	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	1'000	1'250	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	1'450	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH							1'246'125.00	0.22	
CND100002BR5	4.0800 % CGB 4.08 03/01/40 1003	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100008S93	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 INBK	20'000	10'000	0	30'000 CNY	106.65%	3'881'478.38	0.69	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	29'000	0	29'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	138.49%	1'680'086.34	0.30	a)
CND100045MS9	3.7200 % CGB 3.72 04/12/51 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	126.55%	4'605'607.10	0.81	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004R114	2.3700 % CGB 2.37 01/20/27 INBK	35'000	5'000	40'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100054BH7	2.7500 % CGB 2 3/4 06/15/29 INBK	33'000	17'000	0	50'000 CNY	104.04%	6'310'817.33	1.11	a)
CND10005TZQ1	2.8000 % CGB 2.8 11/15/32 INBK	40'000	10'000	0	50'000 CNY	105.05%	6'372'080.33	1.13	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	65'000	15'000	0	80'000 CNY	104.55%	10'146'706.33	1.79	a)
CND100069PK9	3.1900 % CGB 3.19 04/15/53 INBK	15'000	10'000	25'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100076348	2.6700 % CGB 2.67 11/25/33 INBK	0	50'000	20'000	30'000 CNY	104.22%	3'792'968.51	0.67	a)
CND10007C3M6	2.5400 % CGB 2.54 12/25/30 INBK	0	50'000	0	50'000 CNY	103.13%	6'255'559.31	1.10	a)
CN							43'045'303.63	7.60	
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	5'000	0	0	5'000 CZK	106.21%	196'953.97	0.03	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	27'500	0	7'000	20'500 CZK	84.67%	643'717.46	0.11	a)
CZ0001005870	1.2500 % CZGB 1 1/4 02/14/25 120	13'000	0	0	13'000 CZK	99.20%	478'276.90	0.08	a)
CZ0001006167	0.0000 % CZGB 0 12/12/24 135	10'000	0	0	10'000 CZK	99.53%	369'155.18	0.07	a)
CZ							1'688'103.51	0.30	
DE0001030583	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/33 I/L	0	3'000	0	3'000 EUR	116.99%	3'294'828.12	0.58	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	0	20'750	20'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	0	10'500	10'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	2'200	1'000	1'200 EUR	96.11%	1'082'722.94	0.19	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	0	3'500	2'500	1'000 EUR	52.09%	489'018.17	0.09	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	9'000	6'500	2'500 EUR	77.64%	1'822'177.52	0.32	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	0	3'250	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	8'750	8'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQC36	0.1250 % HESSEN 0 1/8 01/25/24 1701	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQEX0	2.6250 % HESSEN 2 5/8 08/25/34	0	7'000	1'000	6'000 EUR	99.05%	5'579'099.10	0.99	a)
DE000A254RB5	0.0000 % NIESA 0 02/11/27 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A352ED1	2.6250 % KFW 2 5/8 01/10/34 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MQYR7	3.0000 % BERGER 3 05/04/28 548	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2331327564	0.0000 % KFW 0 06/15/29 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	8'500	0	8'500	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS2573690489	4.1250 % KFW 4 1/8 02/18/26 EMTN	0	3'000	1'000	2'000 GBP	99.30%	2'207'817.06	0.39	a)
XS2808428853	2.7500 % KFW 2 3/4 04/26/27 EMTN	0	35'000	0	35'000 CNY	101.54%	4'311'380.90	0.76	a)
DE							18'787'043.81	3.32	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	2'000	0	0	2'000 DKK	126.07%	317'368.61	0.06	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	6'500	0	0	6'500 DKK	92.73%	758'624.32	0.13	a)
DK							1'075'992.93	0.19	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	5'000	2'250	7'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	700	0	0	700 EUR	50.88%	334'368.00	0.06	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	7'000	0	0	7'000 EUR	74.70%	4'908'834.80	0.87	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	3'250	0	250	3'000 EUR	67.49%	1'900'761.00	0.34	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	10'000	2'250	2'250	10'000	EUR	85.67%	8'041'876.15	1.42 a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	0	5'500	0	5'500	EUR	69.55%	3'590'934.97	0.63 a)
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	2'400	0	2'400	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
XS2838987506	3.0500 % ICO 3.05 10/31/29 GMTN	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
ES								18'776'774.92	3.32
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	3'000	100	2'900	EUR	101.40%	2'760'486.52	0.49 a)
FI								2'760'486.52	0.49
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 OAT	2'000	7'700	4'200	5'500	EUR	85.07%	4'392'052.84	0.78 a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29 OAT	0	3'750	3'750	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	6'000	0	4'000	2'000	EUR	65.60%	1'231'707.70	0.22 a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	2'200	0	2'200	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53 OAT	1'500	3'000	1'500	3'000	EUR	50.55%	1'423'599.36	0.25 a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32 OAT	0	3'750	150	3'600	EUR	80.46%	2'719'035.63	0.48 a)
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
FR001400F7C9	2.8750 % AGFRNC 2 7/8 01/21/30	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	4'500	0	2'500	2'000	EUR	103.31%	1'939'644.39	0.34 a)
FR								11'706'039.92	2.07
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	2'000	2'000	0	GBP	0.00%	0.00	0.00
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	1'200	4'350	1'550	4'000	GBP	59.86%	2'661'947.15	0.47 a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	4'000	1'000	2'100	2'900	GBP	80.17%	2'584'499.35	0.46 a)
GB00BLBDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	2'000	0	0	2'000	GBP	34.81%	774'033.33	0.14 a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	6'150	6'150	0	GBP	0.00%	0.00	0.00
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	4'000	0	4'000	GBP	63.97%	2'844'666.42	0.50 a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	6'000	4'100	4'900	5'200	GBP	74.84%	4'326'560.15	0.76 a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	4'000	0	2'000	2'000	GBP	48.55%	1'079'373.28	0.19 a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	5'500	0	500	5'000	GBP	38.71%	2'151'420.44	0.38 a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	3'750	750	1'250	3'250	GBP	88.09%	3'182'573.67	0.56 a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	1'600	600	2'200	0	GBP	0.00%	0.00	0.00
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	1'000	0	300	700	GBP	91.66%	713'251.05	0.13 a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	4'750	150	0	4'900	GBP	72.92%	3'972'144.14	0.70 a)
USG6398ADD66	5.2640 % NWIDE 5.264 11/10/26 REGS	0	6'500	0	6'500	USD	101.44%	5'701'261.10	1.01 a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	1'600	0	0	1'600	GBP	98.62%	1'754'176.13	0.31 a)
GB								31'745'906.21	5.61
GR0138018842	4.1250 % GGB 4 1/8 06/15/54	0	3'400	1'400	2'000	EUR	102.19%	1'918'597.42	0.34 a)
GR								1'918'597.42	0.34
HU0000403118	3.0000 % HGB 3 10/27/27 27/A	0	80'000	0	80'000	HUF	90.57%	166'583.48	0.03 a)
HU0000404934	1.5000 % HGB 1 1/2 08/26/26 26/F	0	140'000	0	140'000	HUF	92.31%	297'128.38	0.05 a)
HU								463'711.86	0.08
IDG000009507	8.3750 % INDOGB 8 3/8 09/15/26 FR56	20'000'000	0	0	20'000'000	IDR	103.40%	1'139'283.24	0.20 a)
IDG000010307	6.1250 % INDOGB 6 1/8 05/15/28 FR64	16'800'000	0	0	16'800'000	IDR	98.68%	913'248.97	0.16 a)
IDG000023607	6.6250 % INDOGB 6 5/8 02/15/34 100	0	30'030'000	0	30'030'000	IDR	98.95%	1'637'031.63	0.29 a)
ID								3'689'563.84	0.65
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	4'000	0	0	4'000	ILS	97.99%	905'974.01	0.16 a)
IL								905'974.01	0.16
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	0	7'000	7'000	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24 4Y	3'900	0	3'900	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	4'000	4'000	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	4'000	2'000	2'000	4'000	EUR	72.85%	2'735'655.42	0.48 a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	5'500	4'000	7'000	2'500	EUR	84.27%	1'977'706.36	0.35 a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	4'500	0	4'500	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	7'800	2'800	5'000	EUR	102.95%	4'832'354.13	0.85 a)
IT								9'545'715.91	1.69
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	1'000'000	0	1'000'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	0	625'000	625'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	1'100'000	175'000	925'000	JPY	100.00%	5'250'666.45	0.93 a)
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	0	2'825'000	0	2'825'000	JPY	99.97%	16'031'810.01	2.83 a)
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	2'200'000	375'000	2'575'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	1'500'000	0	1'500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	1'600'000	1'150'000	675'000	2'075'000 JPY	99.23%	11'687'822.89	2.06	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	1'500'000	300'000	1'800'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	1'575'000	0	1'575'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	1'200'000	0	1'200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	1'000'000	3'500'000	1'550'000	2'950'000 JPY	97.87%	16'389'679.27	2.89	a)
JP1120281P52	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/33 28	0	3'500'000	3'500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	500'000	500'000	600'000	400'000 JPY	99.28%	2'254'345.87	0.40	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	89.95%	5'105'889.83	0.90	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	600'000	100'000	0	700'000 JPY	91.95%	3'653'675.87	0.65	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	0	400'000	0	400'000 JPY	88.93%	2'019'331.32	0.36	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	1'000'000	250'000	0	1'250'000 JPY	85.42%	6'061'487.95	1.07	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	1'100'000	800'000	400'000	1'500'000 JPY	84.00%	7'152'446.50	1.26	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	0	600'000	600'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	700'000	100'000	0	800'000 JPY	76.47%	3'472'538.69	0.61	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	1'000'000	800'000	100'000	1'700'000 JPY	71.15%	6'865'938.78	1.21	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	0	800'000	0	800'000 JPY	79.50%	3'610'368.48	0.64	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	0	450'000	450'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	350'000	0	0	350'000 JPY	59.72%	1'186'519.79	0.21	a)
JP1741951PB0	0.0000 % JTDB 0 11/20/24 1195	0	2'200'000	1'475'000	725'000 JPY	99.99%	4'115'346.06	0.73	a)
XS0241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	1'300	0	0	1'300 GBP	92.57%	1'337'861.68	0.24	a)
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REG5	0	4'500	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2296155562	1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REG5	6'000	0	2'000	4'000 USD	81.93%	2'833'760.25	0.50	a)
XS2377379461	0.1000 % JFM 0.1 09/03/31 GMTN	0	8'000	0	8'000 EUR	82.12%	6'167'118.76	1.09	a)
JP							105'196'608.45	18.58	
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	4'500'000	0	4'500'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	2'000'000	3'000'000	0	5'000'000 KRW	84.18%	2'637'244.44	0.47	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	3'500'000	0	0	3'500'000 KRW	83.16%	1'823'648.29	0.32	a)
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	0	4'000'000	2'000'000	2'000'000 KRW	75.00%	939'918.51	0.17	a)
KR103502GA67	1.3750 % KTB 1 3/8 06/10/30 3006	5'000'000	0	500'000	4'500'000 KRW	91.21%	2'571'772.73	0.45	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	2'000'000	2'000'000	0	4'000'000 KRW	101.00%	2'531'303.08	0.45	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	2'600	0	200	2'400 USD	101.53%	2'106'990.28	0.37	a)
XS2895635121	2.8000 % KDB 2.8 09/05/34 EMTN	0	25'000	0	25'000 CNY	99.80%	3'026'695.70	0.53	a)
KR							15'637'573.03	2.76	
XS2765498717	3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LT							0.00	0.00	
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							0.00	0.00	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	480'000	0	480'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	400'000	525'000	575'000	350'000 MXN	89.65%	1'354'199.02	0.24	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	100'000	0	0	100'000 MXN	78.95%	340'714.09	0.06	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	300'000	0	300'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MXMSG0000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	750'000	200'000	550'000 MXN	87.08%	2'067'000.42	0.37	a)
MX							3'761'913.53	0.66	
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	1'500	0	0	1'500 MYR	100.55%	297'838.69	0.05	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	0	5'000	0	5'000 MYR	97.83%	965'940.37	0.17	a)
MYBMS1100036	4.3920 % MGS 4.392 04/15/26 0311	2'000	0	0	2'000 MYR	101.47%	400'739.77	0.07	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	3'000	0	0	3'000 MYR	100.35%	594'480.74	0.10	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	4'000	0	0	4'000 MYR	107.20%	846'730.65	0.15	a)
MYBMZ2300010	4.4570 % MGS 4.457 03/31/53 0123	0	2'000	0	2'000 MYR	103.65%	409'329.50	0.07	a)
MY							3'515'059.72	0.62	
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	97.40%	551'647.00	0.10	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	3'000	3'000	200	5'800 AUD	94.52%	3'104'813.31	0.55	a)
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	0	3'000	1'100	1'900 EUR	90.62%	1'616'264.56	0.29	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1632891138	0.6250 % BNG 0 5/8 06/19/27 EMTN	1'500	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1956184532	2.6250 % BNG 2 5/8 02/27/24 REG5	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2101563646	1.7500 % NEDWBK 1 3/4 01/15/25 REG5	4'000	0	0	4'000 USD	99.39%	3'437'735.91	0.61	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52180643889	1.0000 % NEDWBK 1 05/28/30 REGS	0	8'000	0	8'000 USD	83.48%	5'774'881.66	1.02	a)
X52226241854	0.1250 % NEDWBK 0 1/8 09/03/35	4'000	0	0	4'000 EUR	74.37%	2'792'619.29	0.49	a)
X52332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	0	8'200	200	8'000 EUR	80.30%	6'030'886.10	1.07	a)
X52381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	6'500	3'500	5'000	5'000 EUR	90.92%	4'267'409.16	0.75	a)
X52436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
NL							27'576'256.99	4.87	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	3'000	0	3'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	10'000	3'500	0	13'500 NOK	89.16%	943'589.03	0.17	a)
XS2014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
NO							943'589.03	0.17	
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	2'750	0	2'750	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	0	3'250	3'250	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	2'500	500	500	2'500 NZD	64.77%	833'347.09	0.15	a)
NZLGFDT019C9	3.0000 % NZLGA 3 05/15/35	0	1'500	500	1'000 NZD	82.82%	426'234.01	0.08	a)
X52353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	2'350	4'400	100	6'650 EUR	90.35%	5'640'132.97	1.00	a)
X52500847657	1.7770 % WSTPNZ 1.777 01/14/26 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NZ							6'899'714.07	1.22	
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	0	1'500	0	1'500 PLN	77.95%	252'258.46	0.04	a)
PL							252'258.46	0.04	
XS2770921315	5.6250 % ROMANI 5 5/8 02/22/36 REGS	0	430	430	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
RO							0.00	0.00	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	2'000	0	0	2'000 SEK	114.76%	185'482.95	0.03	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	8'500	0	0	8'500 SEK	88.57%	608'387.58	0.11	a)
US50046PBN42	0.3750 % KOMINS 0 3/8 02/16/24 144A	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87031CAH60	4.6250 % SEK 4 5/8 11/28/25 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	3'000	0	0	3'000 SEK	89.85%	217'818.54	0.04	a)
X52311395169	0.3750 % KOMINS 0 3/8 06/19/24 REGS	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52462606489	0.8750 % KOMINS 0 7/8 09/01/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	92.65%	3'479'152.28	0.61	a)
X52490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52717359447	5.2500 % KOMINS 5 1/4 04/16/25 REGS	0	5'000	3'000	2'000 USD	100.26%	1'733'948.32	0.31	a)
SE							6'224'789.67	1.10	
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	600	0	0	600 SGD	99.12%	388'724.78	0.07	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	750	400	0	1'150 SGD	99.88%	750'783.67	0.13	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	1'200	0	0	1'200 SGD	93.00%	729'477.63	0.13	a)
SG							1'868'986.08	0.33	
X52635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	3'400	2'200	2'600	3'000 USD	100.47%	2'606'240.39	0.46	a)
SI							2'606'240.39	0.46	
TH0623035C07	3.8500 % THAIGB 3.85 12/12/25	40'000	15'000	0	55'000 THB	101.90%	1'436'070.97	0.25	a)
TH0623037C05	3.5800 % THAIGB 3.58 12/17/27	44'000	0	0	44'000 THB	104.12%	1'173'965.75	0.21	a)
TH062303FC01	1.5850 % THAIGB 1.585 12/17/35	0	1'000	0	1'000 THB	91.53%	23'453.63	0.00	a)
TH0623A3B608	3.6500 % THAIGB 3.65 06/20/31	22'000	3'000	0	25'000 THB	108.50%	695'078.46	0.12	a)
TH							3'328'568.81	0.59	
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	3'000	0	400	2'600 USD	78.20%	1'758'178.30	0.31	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	3'250	0	3'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	10'000	4'000	9'000	5'000 USD	50.23%	2'171'883.20	0.38	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	14'000	6'000	2'500	17'500 USD	61.83%	9'355'986.45	1.65	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	14'000	4'000	600	17'400 USD	62.39%	9'387'156.18	1.66	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	0	5'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TP30	1.5000 % T 1 1/2 02/15/53	0	3'000	0	3'000 USD	90.87%	2'357'270.16	0.42	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	0	20'450	0	20'450 USD	98.39%	17'398'527.37	3.07	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	9'000	2'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	25'000	23'000	3'528	44'472 USD	82.53%	31'737'341.35	5.60	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	10'000	3'250	13'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	9'500	0	9'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	3'500	4'250	7'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	10'000	14'000	4'250	19'750 USD	89.13%	15'221'945.82	2.69	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	0	23'900	23'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	18'500	1'500	3'000	17'000 USD	89.34%	13'133'441.91	2.32	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	0	21'500	21'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	0	19'000	4'500	14'500 USD	99.84%	12'518'069.40	2.21	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	30'000	500	650	29'850 USD	82.72%	21'350'780.59	3.77	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	7'750	0	7'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	17'200	5'700	11'500 USD	97.86%	9'731'185.18	1.72	a)
US							146'121'765.91	25.80	
EU000A3K4D66	0.0000 % EUB 0 11/10/23 6M	5'650	0	5'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	0	9'000	2'000	7'000 EUR	87.64%	5'758'965.26	1.02	a)
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	0	4'500	1'500	3'000 EUR	84.50%	2'379'809.55	0.42	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	4'750	7'000	11'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EM7	0.0000 % EUB 0 05/10/24 6M	0	8'750	8'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4ES4	3.0000 % EU 3 12/04/34 NGEU	0	3'500	500	3'000 EUR	100.10%	2'818'951.47	0.50	a)
EU000A3K4EV8	0.0000 % EUB 0 10/04/24 6M	0	7'500	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 SURE	6'000	2'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	4'500	0	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3LS460	2.7500 % EIB 2 3/4 01/16/34 EARN	0	4'000	200	3'800 EUR	99.03%	3'532'787.32	0.62	a)
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	0	7'000'000	0	7'000'000 COP	88.95%	1'219'992.98	0.22	a)
XS2332976237	1.0000 % EIB 1 02/15/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 PLN	90.69%	1'956'545.03	0.35	a)
XS2577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	30'000	0	30'000 CNY	101.30%	3'686'844.00	0.65	a)
XS							21'353'895.61	3.77	

Derivative Finanzinstrumente
-21'898.29 0.00
Futures

							0.00	0.00
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	-100	100	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/23	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	30	0	30	0 USD	0.00	0.00	0.00
12/23	US ULTRA BOND CBT DEC23	-30	30	0	0 USD	0.00	0.00	0.00
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	0	50	50	0 GBP	0.00	0.00	0.00
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	100	0	100	0 USD	0.00	0.00	0.00
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	130	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	US 10YR NOTE (CBT)MAR24	0	85	85	0 USD	0.00	0.00	0.00
03/24	US ULTRA BOND CBT MAR24	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	25	25	0 EUR	0.00	0.00	0.00
06/24	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	0	85	85	0 USD	0.00	0.00	0.00
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	90	90	0 USD	0.00	0.00	0.00
06/24	US ULTRA BOND CBT JUN24	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00
06/24	US 5YR NOTE (CBT) JUN24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	225	225	0 EUR	0.00	0.00	0.00
09/24	US 10YR NOTE (CBT)SEP24	0	60	60	0 USD	0.00	0.00	0.00
09/24	US 10YR ULTRA FUT SEP24	0	240	240	0 USD	0.00	0.00	0.00
09/24	US ULTRA BOND CBT SEP24	0	10	10	0 USD	0.00	0.00	0.00
09/24	LONG GILT FUTURE SEP24	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00
09/24	US 5YR NOTE (CBT) SEP24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00
12/24	EURO-BUND FUTURE DEC24	0	175	175	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/24	US 10YR ULTRA FUT DEC24	0	125	55	70 USD	0.00	0.00	0.00 a)
12/24	US ULTRA BOND CBT DEC24	0	0	10	-10 USD	0.00	0.00	0.00 a)
12/24	LONG GILT FUTURE DEC24	0	35	0	35 GBP	0.00	0.00	0.00 a)
12/24	US 5YR NOTE (CBT) DEC24	0	50	0	50 USD	0.00	0.00	0.00 a)

Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall 21.02.2024	3'397'859	3'000'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 06.05.2024	1'600'000	1'836'755	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/MXN	Verfall 07.05.2024	14'876'027	800'000	MXN/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 07.05.2024	16'000'000	14'668'640	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 07.05.2024	9'000'000	8'824'194	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/NOK	Verfall 29.08.2024	83'992'909	7'000'000	NOK/EUR	0.00	0.00
EUR/NOK	Verfall 27.09.2024	82'438'377	7'000'000	NOK/EUR	0.00	0.00
NOK/EUR	Verfall 27.09.2024	1'000'000	11'717'127	EUR/NOK	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 16.10.2024	1'350'000	1'265'925	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.10.2024	1'250'000	1'071'955	USD/CHF	0.00	0.00
EUR/NOK	Verfall 25.10.2024	70'100'628	6'000'000	NOK/EUR	0.00	0.00
NOK/EUR	Verfall 25.10.2024	750'000	8'806'547	EUR/NOK	0.00	0.00
EUR/NOK	Verfall 29.11.2024	62'046'038	5'250'000	NOK/EUR	-69'102.10	-0.01 b)

Devisentermingeschäfte
-69'102.10 -0.01
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

MXN/CHF	Verfall 16.11.2023	3'195'165	61'800'000	CHF/MXN	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 16.11.2023	220'560	2'650'000	CHF/NOK	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023	12'960'133	11'750'000	CHF/GBP	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 16.11.2023	359'204	2'800'000	CHF/DKK	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 16.11.2023	1'142'340	2'150'000	CHF/NZD	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023	689'330	3'350'000	CHF/PLN	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023	58'013'843	60'700'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023	4'945'317	7'450'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.11.2023	82'771'697	93'050'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023	52'861'548	8'700'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023	21'331'406	174'550'000	CHF/CNY	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 16.11.2023	298'438	3'700'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CZK/CHF	Verfall 16.11.2023	532'343	13'650'000	CHF/CZK	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 16.11.2023	4'342'785	7'500'000	CHF/AUD	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 16.11.2023	491'667	2'100'000	CHF/ILS	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 16.11.2023	655'103	1'000'000	CHF/SGD	0.00	0.00
HUF/CHF	Verfall 16.11.2023	53'257	21'650'000	CHF/HUF	0.00	0.00
THB/CHF	Verfall 16.11.2023	1'391'220	56'250'000	CHF/THB	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.11.2023	350'000	311'491	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023	90'000'000	547'168	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.11.2023	650'000	590'455	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.11.2023	273'541	300'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023	1'106'887	180'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		12'837	250'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		241'340	250'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		5'927	150'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		293'778	2'350'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		16'203	650'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		11'886	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		111'277	100'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		33'420	50'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		10'378	50'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 16.11.2023		850	350'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		100'000	57'887	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		500'000	480'151	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		100'000	110'716	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		60'000'000	369'942	JPY/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		121'222	20'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		859'357	900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		858'172	950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		220'755	200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		650'000	614'373	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		150'000	163'342	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'300'000	1'164'810	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		100'000'000	598'637	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		100'000	108'609	GBP/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		234'911	1'100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		166'230	1'350'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		131'796	200'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		4'042	50'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		109'456	100'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		65'058	100'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		4'053	50'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		138'899	23'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		100'000	57'269	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		1'532'006	1'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		47'233	950'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		185'372	1'450'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		8'715	350'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		1'001'708	1'050'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		2'087'799	16'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		449'104	11'500'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		7'723'619	8'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		183'094	2'250'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'067	300'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		6'390'750	6'650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		26'427	50'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		518'033	900'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		10'125	400'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		288'878	3'550'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		4'419'555	735'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		1'819'452	1'650'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		864'553	15'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		4'002'668	6'000'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		900'000	1'350'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		263'312	4'500'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		150'000'000	101'554	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		75'000'000	4'379	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		80'000'000	4'532	IDR/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		26'570	40'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		8'484	150'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		67'162	100'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		7'340'000'000	4'981'242	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		19'495'000'000	1'120'003	IDR/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		505'151	6'050'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		821'306	1'250'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		5'002'274	8'700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		24'364'963	199'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		3'290'160	65'300'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		92'609'554	104'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		996'650	25'450'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		555'336	4'300'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		4'974'138	7'700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		66'723'357	69'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		514'943	2'200'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		1'164'381	2'200'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		56'373'190	9'500'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		15'234'317	13'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		1'433'931	58'100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		989'921	4'550'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		56'476	22'300'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		511'403	6'300'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 18.01.2024		6'000'000	302'008		MXN/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		912'630	950'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		964'009	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'569'954	2'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		2'679'886	2'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		741	300'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		10'861	50'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		200'137	350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		224'697	350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		1'935'434	325'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		32'524	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		828'532	6'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		548'903	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		17'474	700'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		106'280	2'150'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		25'277	200'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		783'067	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		53'458	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		24'967	300'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'177'455	1'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		19'956	250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		32'789	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		11'705	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		600'000	564'743		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		1'189'376	200'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		950'000	544'263		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		767'264	6'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		3'000'000	18'380		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		713'352	650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'246'332	2'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		17'302	450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		8'256	100'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		2'484	100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		12'647	150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		12'674	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		87'195	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		403'095	750'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		129'288	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		92'513	1'850'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		12'146	100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		708'256	750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 18.01.2024		50'000	6'345		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		650'000'000	3'949'062		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		650'000	25'017		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		7'550'000	6'531'973		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 18.01.2024		11'150'000	1'352'885		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		100'000	8'488		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 18.01.2024		50'000	11'814		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		4'200'000	3'971'218		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 18.01.2024		150'000	12'481		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		1'750'000	43'356		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 18.01.2024		50'000	10'887		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		550'000	318'826		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 18.01.2024		550'000	295'288		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 18.01.2024		650'000	1'593		HUF/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 18.01.2024		1'800'000	89'881		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		550'000	601'747		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		200'000	129'230		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		8'737'024	10'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		61'598	2'500'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		1'464'024	1'350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		5'932'697	6'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		5'312'754	880'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		1'314'339	10'950'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		269'017	500'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		387'567	7'750'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		464'648	800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		128'702	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		38'236	1'000'000		CHF/CZK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		12'630	100'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 18.01.2024		1'592	650'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		11'813	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		8'317	100'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		21'659	100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		16'936	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		200'000	214'317	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		1'000'000	841'382	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		250'000'000	1'495'513	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		450'000	418'729	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 18.01.2024		1'000'000	118'289	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		600'000	647'785	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		1'150'000	1'068'835	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		1'850'000	153'957	SEK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		761'658	130'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		5'205'432	7'700'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		1'080'128	19'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		50'562	900'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		430'749	650'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		3'059	55'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		113'084	170'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		270'000'000	180'602	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 19.01.2024		580'000'000	32'493	IDR/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		193'548	300'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		35'714	650'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 19.01.2024		20'025'000'000	1'104'200	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		8'550'000'000	5'514'208	KRW/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.02.2024		701'797	750'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.02.2024		2'941'183	3'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		1'093'565	20'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		98'453	1'750'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 08.03.2024		44'457	800'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 08.03.2024		22'550'000'000	1'267'666	IDR/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		1'005'741	4'750'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		65'700'219	70'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		15'476'604	14'300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		510'941	2'250'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		1'416'374	60'450'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		995'009	26'500'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		829'811	1'300'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		5'109'182	8'050'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		24'847'174	209'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024		56'199	22'800'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		538'502	6'550'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		55'465'169	9'450'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		91'952'239	107'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		2'845'522	57'700'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		4'154'095	7'350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		1'576'620	3'000'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		540'038	6'600'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		575'230	4'600'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 14.03.2024		675'000	1'648	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 14.03.2024		25'000	5'686	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		1'825'000	44'362	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024		100'000	12'520	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		325'000	171'031	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		200'000	16'395	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		125'000	26'518	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		150'000	12'347	SEK/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		246'664	5'000'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		4'097	50'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		586'400	100'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		451'836	800'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		243'550	10'000'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		6'295	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		273'266	250'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		4'119	50'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		11'342	300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		938'515	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'899'036	2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		838'901	7'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		100'000	52'879	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		500'000	471'582	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		750'000	648'322	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'544'017	1'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		2'914'432	3'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		2'045'895	17'100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		383'700	600'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		2'758'490	470'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'074'906	1'250'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		2'500'000	2'207'243	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		2'225'450	2'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		100'000	65'166	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'892'944	2'150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		2'416'181	2'550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		527'811	90'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		159'768	6'500'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		88'031	400'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		444'545	400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		374'726	650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		8'000'000	979'352	CNY/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		65'571	100'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		34'094	400'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		264'013	5'150'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		38'336	300'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		50'000	44'024	USD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		81'691	150'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		48'448	200'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		101'371	2'700'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		285'703	300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		37'697	450'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024		5'160	2'100'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		20'768	250'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		16'990	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		3'094'511	530'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		199'820	350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		68'243	2'800'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		161'971	250'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		12'235	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 14.03.2024		2'056	850'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		8'216'827	9'350'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		25'565	200'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		44'074	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		1'946'369	1'750'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		1'742'498	14'300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		6'764'383	7'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		125'716	2'450'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		53'505	100'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		32'648	50'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		33'790	900'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		5'495'855	8'550'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		200'000'000	128'783	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		73'776	115'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		394'737	600'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		242'718	375'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		9'440'000'000	6'321'502	KRW/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		108'154'126	123'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		79'088'326	82'700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		62'520'079	10'495'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		18'054'570	16'150'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		5'798'795	8'950'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		28'880'714	236'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		602'272	7'250'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		611'125	7'150'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		647'885	5'050'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		1'146'910	30'400'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		1'157'380	5'200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.04.2024		59'364	24'900'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.04.2024		953'223	1'450'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.04.2024		597'230	2'500'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		3'633'752	70'400'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		1'900'238	77'500'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		2'438'008	410'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		2'400'000	2'297'770	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		1'250'000	1'202'763	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		110'000'000	652'641	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		100'000	89'989	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		1'122'307	1'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		2'250'000	13'421		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		50'000	4'258		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		200'000	7'703		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		50'000	2'688		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		200'000	24'870		CNY/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		2'482	100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.04.2024		994	400'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		806'173	135'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		4'246	50'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		33'438	50'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		473'871	3'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		11'576	300'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		4'209	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		13'126	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		1'355'696	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		57'032	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		28'341	1'150'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		35'316	650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		2'055'782	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		22'770	100'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		300'000	340'741		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		1'750'000	93'638		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		450'000	17'277		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'650'000	1'505'516		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		250'000'000	1'470'675		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		5'283'658	9'150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		1'557'961	2'900'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		882'722	1'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		27'059	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		88'787	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		50'000	26'807		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		150'000	87'581		AUD/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		1'260'837	22'600'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		6'276'521	9'400'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.04.2024		600'000'000	33'994		IDR/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		1'977	35'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.04.2024		16'949	300'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		80'214	120'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		9'520'000'000	6'303'592		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.04.2024		22'335'000'000	1'256'540		IDR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		110'374'233	121'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		17'704'749	15'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		5'875'152	8'850'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		78'455'973	80'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		60'840'291	10'330'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		6'174'210	10'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		30'786'668	246'250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		657'970	5'050'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		61'881	25'150'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		602'588	2'500'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		3'668'490	69'150'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		1'903'868	77'700'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		967'385	1'450'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		595'236	7'100'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		1'533'554	2'850'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		593'050	7'150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		1'152'147	30'000'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 30.05.2024		1'000'000	541'915		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 30.05.2024		750'000	499'910		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.05.2024		1'000'000	974'519		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.05.2024		300'000	341'069		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 30.05.2024		50'000	1'935		CZK/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		100'244	150'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 30.05.2024		450'000	56'487		CNY/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		4'130	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		876'218	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		1'815'820	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		284'862	250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		581'881	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		2'454	100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		223'437	90'000'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 30.05.2024		300'000	15'913		MXN/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		12'511	150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		59'421	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		534'318	10'000'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		4'783'593	820'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		6'900'681	7'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		29'623	1'200'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		19'417	500'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		8'321'277	9'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		12'260	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		13'126	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 30.05.2024		12'392	150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		99'869	150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 30.05.2024		15'109	6'050'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		1'431'438	1'250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		33'564	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		1'950'702	15'450'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		1'579'193	1'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		1'191'906	5'300'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 31.05.2024		50'000	11'252		PLN/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		146'416	650'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		22'595	100'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		6'269'592	9'500'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 31.05.2024		1'240'223	22'200'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		200'000'000	133'333		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 31.05.2024		200'000'000	11'206		IDR/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		33'048	50'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 31.05.2024		1'003'099	17'800'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		399'483	600'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		9'950'000'000	6'662'421		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 31.05.2024		39'800'000'000	2'251'577		IDR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.07.2024		6'405'909	10'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.07.2024		32'689'690	261'250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 11.07.2024		310'250	121'200'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 11.07.2024		1'387'068	6'000'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 11.07.2024		1'215'747	30'450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		1'958'015	79'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.07.2024		5'484'608	8'250'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.07.2024		1'031'377	1'850'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		121'871'084	134'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 11.07.2024		681'494	5'150'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.07.2024		65'386'688	11'250'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.07.2024		623'957	7'250'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.07.2024		19'563'525	16'900'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 11.07.2024		1'110'952	1'650'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		86'542'535	87'700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.07.2024		4'240'356	78'850'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 11.07.2024		635'268	7'350'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 11.07.2024		628'950	2'550'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.07.2024		126'850'000	734'047		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.07.2024		1'750'000	1'711'311		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		9'712'919	10'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.07.2024		833'644	15'860'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.07.2024		1'265'864	1'920'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.07.2024		4'179'458	725'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.07.2024		179'766	300'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.07.2024		2'789'820	22'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		6'939'718	7'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.07.2024		1'512'311	1'320'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 11.07.2024		4'900'000	246'731		MXN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		888'208	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		1'162'109	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 11.07.2024		16'614	200'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.07.2024		29'357	50'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.07.2024		174'585	3'650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		4'846	200'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.07.2024		16'843	200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 11.07.2024		8'687	3'650'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.07.2024		54'452	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 11.07.2024		11'931	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 11.07.2024		10'845	50'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 11.07.2024		32'811	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.07.2024		129'136	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 11.07.2024		6'369	50'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.07.2024		281'336	250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.07.2024		905'742	160'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 11.07.2024		17'279	450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		2'841'731	3'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.07.2024		3'100'000	378'513		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 11.07.2024		50'000	4'225		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 11.07.2024		500'000	12'096		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.07.2024		800'000	473'998		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.07.2024		3'050'000	2'907'897		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 11.07.2024		50'000	4'255		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.07.2024		100'000	64'919		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.07.2024		6'500'000	5'775'679		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 11.07.2024		150'000	5'739		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.07.2024		435'000'000	2'441'211		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 11.07.2024		1'600'000	3'842		HUF/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 11.07.2024		15'000'000	722'318		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 11.07.2024		30'750'000	1'181'477		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 11.07.2024		123'250'000	303'146		HUF/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 11.07.2024		7'400'000	628'852		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.07.2024		11'573'150'000	64'372'175		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 11.07.2024		1'950'000	1'071'701		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.07.2024		18'470'000	21'218'151		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.07.2024		10'150'000	6'134'356		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 11.07.2024		6'050'000	1'378'547		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.07.2024		143'070'000	128'421'063		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 11.07.2024		7'500'000	634'425		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 11.07.2024		2'600'000	635'570		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 11.07.2024		1'700'000	1'129'582		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 11.07.2024		5'200'000	676'780		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.07.2024		91'200'000	88'541'520		EUR/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		80'640'978	80'640'978		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.07.2024		10'270'000	6'759'817		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 11.07.2024		78'460'000	3'922'804		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.07.2024		280'650'000	34'542'402		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 11.07.2024		78'700'000	1'940'978		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 11.07.2024		6'642'185	9'950'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 11.07.2024		2'233'634	39'800'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 11.07.2024		191'083	300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 11.07.2024		40'214	750'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 11.07.2024		680'000'000	37'466		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 11.07.2024		10'250'000'000	6'662'953		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 11.07.2024		39'870'000'000	2'201'352		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 29.08.2024		1'187'368	31'050'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 29.08.2024		304'994	124'950'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 29.08.2024		630'941	7'450'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 29.08.2024		1'065'486	1'950'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 29.08.2024		65'261'805	11'715'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		21'537'162	18'850'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 29.08.2024		6'076'695	10'100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 29.08.2024		1'369'787	6'050'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		133'059'077	149'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 29.08.2024		627'290	7'450'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 29.08.2024		1'125'516	1'700'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 29.08.2024		633'004	2'600'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		90'743'527	93'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 29.08.2024		674'716	5'200'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 29.08.2024		6'715'349	10'250'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 29.08.2024		3'969'898	80'500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 29.08.2024		35'530'914	289'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 29.08.2024		1'967'120	80'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.08.2024		1'250'000	1'100'429		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.08.2024		1'550'000	1'358'189		USD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 29.08.2024		4'061	50'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		5'050'000	4'812'367		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 29.08.2024		1'550'000	984'329		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 29.08.2024		200'000	225'801		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 29.08.2024		100'000'000	573'095		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 29.08.2024		300'000	14'249		MXN/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 29.08.2024		3'976'200	50'000'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 29.08.2024		7'504	200'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 29.08.2024		1'089	450'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.08.2024		500'000	60'768		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 29.08.2024		550'000	13'357		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 29.08.2024		100'000	8'017		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.08.2024		5'600'000	682'265		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 29.08.2024		50'000	11'885		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 29.08.2024		309'590	2'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 29.08.2024		2'543'463	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 29.08.2024		1'301'000	1'400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 29.08.2024		1'950'000	1'024'179	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 29.08.2024		80'200'000	3'434'814	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 29.08.2024		5'200'000	655'928	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 29.08.2024		7'500'000	620'775	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/HUF	Verfall 29.08.2024		125'400'000	299'994	HUF/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 29.08.2024		2'550'000	583'644	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 29.08.2024		1'700'000	1'099'305	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 29.08.2024		31'250'000	1'175'250	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 29.08.2024		149'300'000	125'816'603	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 29.08.2024		286'000'000	33'805'200	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 29.08.2024		57'350'000	4'609'220	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 29.08.2024		11'615'000'000	67'854'830	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 29.08.2024		10'100'000	5'771'140	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 29.08.2024		8'700'000	5'449'158	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 29.08.2024		6'050'000	1'327'945	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 29.08.2024		18'650'000	20'799'226	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 29.08.2024		90'150'000	84'835'658	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 29.08.2024		79'450'000	1'965'514	THB/CHF		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 29.08.2024		2'177'643	39'850'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 29.08.2024		6'638'829	10'250'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 29.08.2024		952'444	1'500'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 29.08.2024		26'834	500'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 29.08.2024		40'350'000'000	2'203'148	IDR/CHF		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 29.08.2024		11'750'000'000	7'470'990	KRW/CHF		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 27.09.2024		1'046'960	2'000'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 27.09.2024		3'647'174	85'850'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 27.09.2024		661'064	5'250'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 27.09.2024		619'606	7'500'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
HUF/CHF	Verfall 27.09.2024		299'376	125'700'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 27.09.2024		1'097'326	1'700'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 27.09.2024		570'833	2'500'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 27.09.2024		1'171'349	31'150'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.09.2024		128'075'295	152'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 27.09.2024		34'169'434	289'150'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 27.09.2024		4'632'554	57'800'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.09.2024		70'160'040	12'000'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.09.2024		5'898'289	10'350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 27.09.2024		5'872'838	9'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 27.09.2024		1'333'863	6'100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.09.2024		21'067'852	18'950'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.09.2024		85'035'414	90'550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 27.09.2024		1'954'491	79'150'000	CHF/THB		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 27.09.2024		4'200'000	336'512	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 27.09.2024		950'000	40'718	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 27.09.2024		200'000	221'876	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.09.2024		390'000'000	2'273'922	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 27.09.2024		550'000	13'613	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 27.09.2024		2'700'000	319'010	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.09.2024		1'100'000	1'028'774	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.09.2024		3'000'000	2'517'756	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 27.09.2024		250'000	9'329	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 27.09.2024		7'350'000	588'978	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/HUF	Verfall 27.09.2024		1'050'000	2'490	HUF/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.09.2024		50'000	28'519	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 27.09.2024		50'000	10'873	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 27.09.2024		100'000	111'362	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 27.09.2024		500'000	21'223	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 27.09.2024		200'000	7'479	CZK/CHF		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 27.09.2024		314'126	3'900'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.09.2024		4'300'000	3'638'454	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 27.09.2024		400'000	9'997	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/HUF	Verfall 27.09.2024		600'000	1'429	HUF/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.09.2024		3'150'000	2'953'957	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 27.09.2024		50'000	6'289	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.09.2024		460'000'000	2'686'492	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.09.2024		50'000	28'756	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 27.09.2024		50'000	4'134	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 27.09.2024		1'200'000	143'522	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.09.2024		550'000	345'630	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.09.2024		3'150'000	2'953'456	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.09.2024		850'000	534'049	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.09.2024		800'000	459'557	AUD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/NOK Verfall 27.09.2024		600'000	47'959	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 27.09.2024		325'000	172'062	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 27.09.2024		13'400'000	1'603'806	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.09.2024		1'150'000	1'279'158	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 27.09.2024		100'000	21'902	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 27.09.2024		50'000	6'287	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 27.09.2024		1'550'000	3'695	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.09.2024		4'700'000	3'976'778	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.09.2024		150'000'000	874'673	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 27.09.2024		7'600'000	326'233	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 27.09.2024		950'000	23'805	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 27.09.2024		100'000	8'273	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 27.09.2024		3'950'000	147'894	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.09.2024		65'550'000	385'864	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 27.09.2024		300'000	23'924	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 27.09.2024		450'000	11'453	THB/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.09.2024		130'869	250'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.09.2024		3'452'694	4'050'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 27.09.2024		5'500'000	236'314	MXN/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.09.2024		60'029	10'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.09.2024		101'791	850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.09.2024		31'382	50'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.09.2024		517'796	550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.09.2024		278'365	250'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 27.09.2024		200'000	476	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.09.2024		17'750'000	20'152'640	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 27.09.2024		1'925'000	1'029'798	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.09.2024		83'700'000	79'385'265	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 27.09.2024		1'700'000	1'121'983	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.09.2024		10'944'450'000	64'354'460	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 27.09.2024		49'250'000	3'976'445	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 27.09.2024		26'750'000	1'008'903	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 27.09.2024		122'300'000	293'471	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 27.09.2024		5'950'000	1'322'286	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 27.09.2024		5'150'000	655'029	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 27.09.2024		9'450'000	5'505'476	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 27.09.2024		7'350'000	615'416	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 27.09.2024		8'050'000	5'078'182	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 27.09.2024		71'300'000	3'105'999	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 27.09.2024		2'500'000	567'100	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.09.2024		144'550'000	122'714'277	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 27.09.2024		272'700'000	32'933'979	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 27.09.2024		76'800'000	1'993'882	THB/CHF		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 30.09.2024		2'190'352	40'350'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 30.09.2024		7'456'502	11'750'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 30.09.2024		41'026	65'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 30.09.2024		350'000'000	19'071	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 30.09.2024		195'000'000	10'681	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 30.09.2024		40'000'000	25'399	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 30.09.2024		500'000'000	27'337	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 30.09.2024		2'000'000'000	1'275'510	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 30.09.2024		125'000'000	6'910	IDR/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 30.09.2024		635'728	1'000'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 30.09.2024		10'775'000'000	6'844'494	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 30.09.2024		39'180'000'000	2'187'947	IDR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024		19'690'205	17'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024		1'013'112	1'900'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024		77'700'754	82'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024		1'086'914	1'650'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024		63'838'254	10'850'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.10.2024		3'932'376	48'850'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024		989'222	26'300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.10.2024		291'006	121'800'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.10.2024		1'306'036	5'900'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024		647'471	5'100'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024		5'431'761	9'350'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024		605'853	7'250'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024		5'033'232	8'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024		3'131'463	72'450'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024		118'971'643	140'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024		32'825'776	272'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024		1'981'003	76'450'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.10.2024		2'300'000	1'943'944	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.10.2024		9'950'000	428'286	MXN/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/JPY	Verfall 25.10.2024		150'000'000	878'453		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 25.10.2024		1'300'000	1'228'126		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 25.10.2024		11'250'000	479'759		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 25.10.2024		200'000	43'923		PLN/CHF	0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 25.10.2024		2'950'000	76'598		THB/CHF	0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 25.10.2024		100'000	65'686		SGD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 25.10.2024		18'800'000	15'785'025		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 25.10.2024		150'000	18'906		DKK/CHF	0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 25.10.2024		250'000	20'855		SEK/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 25.10.2024		6'750'000	540'635		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 25.10.2024		950'000	35'475		CZK/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 25.10.2024		26'250'000	3'164'411		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 25.10.2024		950'000	591'832		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 25.10.2024		9'950'000	9'348'393		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 25.10.2024		500'000	267'244		NZD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 25.10.2024		1'400'000'000	8'254'344		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 25.10.2024		850'000	494'800		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 25.10.2024		2'150'000	2'420'244		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/HUF	Verfall 25.10.2024		4'550'000	10'746		HUF/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 25.10.2024		950'000	41'798		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 25.10.2024		200'000	223'742		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 25.10.2024		100'000	57'681		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 25.10.2024		3'250'000	393'959		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 25.10.2024		100'000'000	575'440		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 25.10.2024		119'500'000	103'607'695		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 25.10.2024		73'500'000	1'902'107		THB/CHF	0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 25.10.2024		1'550'000	1'015'467		SGD/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 25.10.2024		42'100'000	3'311'586		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 25.10.2024		7'050'000	4'414'851		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 25.10.2024		70'850'000	66'188'070		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 25.10.2024		4'950'000	619'988		DKK/CHF	0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 25.10.2024		7'000'000	572'110		SEK/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 25.10.2024		242'500'000	29'441'925		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/HUF	Verfall 25.10.2024		117'250'000	271'516		HUF/CHF	0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 25.10.2024		1'400'000	729'148		NZD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 25.10.2024		15'050'000	16'894'227		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 25.10.2024		5'700'000	1'224'827		PLN/CHF	0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 25.10.2024		25'350'000	937'722		CZK/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 25.10.2024		50'300'000	2'182'512		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 25.10.2024		8'400'000	4'833'024		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 25.10.2024		9'200'000'000	52'118'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 28.10.2024		554'266	2'450'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 28.10.2024		50'000	11'357		ILS/CHF	0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 28.10.2024		2'400'000	548'568		ILS/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 28.10.2024		6'844'267	10'800'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 28.10.2024		2'166'041	39'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 28.10.2024		1'600'000'000	1'032'258		KRW/CHF	0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 28.10.2024		1'675'000'000	93'050		IDR/CHF	0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 28.10.2024		37'325'000'000	2'071'678		IDR/CHF	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 28.10.2024		9'200'000'000	5'780'289		KRW/CHF	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 29.11.2024		546'967	2'400'000		CHF/ILS	-6'189.89	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 29.11.2024		1'926'973	74'750'000		CHF/THB	16'441.15	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 29.11.2024		1'045'885	1'600'000		CHF/SGD	2'012.44	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 29.11.2024		3'346'783	42'700'000		CHF/NOK	8'970.48	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 29.11.2024		4'371'563	7'000'000		CHF/CAD	38'801.42	0.01	b)
EUR/CHF	Verfall 29.11.2024		67'524'849	72'450'000		CHF/EUR	-360'021.70	-0.06	b)
DKK/CHF	Verfall 29.11.2024		618'760	4'950'000		CHF/DKK	-3'282.58	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 29.11.2024		570'893	7'000'000		CHF/SEK	6'126.13	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 29.11.2024		30'057'131	247'900'000		CHF/CNY	15'586.26	0.00	b)
HUF/CHF	Verfall 29.11.2024		273'509	118'750'000		CHF/HUF	1'715.61	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 29.11.2024		700'531	1'350'000		CHF/NZD	7'759.68	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 29.11.2024		17'108'429	15'300'000		CHF/GBP	152'097.43	0.03	b)
PLN/CHF	Verfall 29.11.2024		1'219'008	5'700'000		CHF/PLN	-5'560.03	0.00	b)
CZK/CHF	Verfall 29.11.2024		943'980	25'600'000		CHF/CZK	-3'077.50	0.00	b)
MXN/CHF	Verfall 29.11.2024		2'149'542	50'050'000		CHF/MXN	5'646.87	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 29.11.2024		4'759'120	8'300'000		CHF/AUD	71'005.83	0.01	b)
JPY/CHF	Verfall 29.11.2024		52'695'586	9'295'000'000		CHF/JPY	-103'272.98	-0.02	b)
CHF/GBP	Verfall 29.11.2024		600'000	674'613		GBP/CHF	-9'656.38	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 29.11.2024		56'238	2'200'000		CHF/THB	0.00	0.00	b)
HUF/CHF	Verfall 29.11.2024		6'642	2'900'000		CHF/HUF	0.00	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 29.11.2024		3'691'792	650'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 29.11.2024		720'663	650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 29.11.2024		25'663	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 29.11.2024		2'066'255	17'050'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 29.11.2024		169'489	300'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 29.11.2024		3'842'172	4'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 29.11.2024		12'568	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 29.11.2024		32'250	150'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 29.11.2024		11'533	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 29.11.2024		123'813	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 29.11.2024		89'915	1'150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 29.11.2024		72'837	1'700'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 29.11.2024		16'137	200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 29.11.2024		22'201	600'000		CHF/CZK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 29.11.2024		32'627	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 02.12.2024		104'731'512	121'300'000		CHF/USD	191'528.70	0.03	b)
	USD/CHF Verfall 02.12.2024		6'551'284	7'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 02.12.2024		2'056'157	37'325'000'000		CHF/IDR	10'070.25	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 02.12.2024		5'768'484	9'200'000'000		CHF/KRW	13'293.38	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 02.12.2024		67'916	1'250'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 02.12.2024		221'538	360'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							49'994.57	0.01	

Swaps

							Kurswert CHF	in % 7)
09/28	IRS FIX LEG 3.37% P.A. EUR	23'000	0	23'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00
09/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	-23'000	23'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00
06/33	IRS FIX LEG 0.56925% P.A. JPY	1'200'000	0	1'200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00
06/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'200'000	1'200'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00
11/54	IRS FIX LEG 2.1819% P.A. EUR	0	0	3'500	-3'500 EUR	100.08%	-3'288'446.11	-0.58 b)
11/54	IRS FLOATING LEG - EUR - ESTRON	0	3'500	0	3'500 EUR	100.00	3'285'655.35	0.58 b)
							-2'790.76	0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'417'282.46	0.96
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	557'489'123.47	98.45
Derivative Finanzinstrumente	-21'898.29	0.00
Sonstige Vermögenswerte	3'378'469.40	0.60
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	566'262'977.04	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-16'912'600.92	
Andere Verbindlichkeiten	-29'067.02	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	549'321'309.10	

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);	557'489'123.47	98.45
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-21'898.29	0.00
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)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	167'215'059.43	29.53
AT0000A269M8 0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	2'850 EUR 91.91%	2'458'963.81 0.43
AU0000083768 0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	400 AUD 99.81%	226'111.89 0.04
AU0000143901 1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	1'000 AUD 82.10%	465'019.40 0.08
BE0000360694 2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	2'985 EUR 98.96%	2'773'163.89 0.49
DE0001102408 0.0000 % DBR 0 08/15/26	1'200 EUR 96.11%	1'082'722.94 0.19
DE0001102481 0.0000 % DBR 0 08/15/50	1'000 EUR 52.09%	489'018.17 0.09
ES0000012124 0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	7'000 EUR 74.70%	4'908'834.80 0.87
ES0000012K20 0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	10'000 EUR 85.67%	8'041'876.15 1.42
EU000A3K4DD8 1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	1'220 EUR 87.64%	1'003'705.37 0.18
FR0013313582 1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34 OAT	5'500 EUR 85.07%	4'392'052.84 0.78
FR0013515806 0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	1'970 EUR 65.60%	1'213'232.09 0.21
GB00BJQWYH73 1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	2'650 GBP 59.86%	1'763'539.99 0.31

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.10.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	229 GBP	74.84%	190'535.05	0.03	
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'000 GBP	48.55%	1'079'373.28	0.19	
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	3'000 GBP	88.09%	2'937'760.31	0.52	
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	1'900 EUR	90.62%	1'616'264.56	0.29	
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	2'600 USD	78.20%	1'758'178.30	0.31	
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	5'000 USD	50.23%	2'171'883.20	0.38	
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	17'500 USD	61.83%	9'355'986.45	1.65	
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	14'120 USD	62.39%	7'617'623.29	1.35	
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	11'000 USD	98.39%	9'358'621.08	1.65	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	40'870 USD	82.53%	29'166'782.27	5.15	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	18'799 USD	89.13%	14'488'980.23	2.56	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	17'000 USD	89.34%	13'133'441.91	2.32	
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	14'500 USD	99.84%	12'518'069.40	2.21	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	29'850 USD	82.72%	21'350'780.59	3.77	
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	9'265 USD	97.86%	7'839'950.49	1.38	
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	1'900 USD	104.96%	1'724'419.33	0.30	
XS2296155562	1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REGS	500 USD	81.93%	354'220.03	0.06	
XS2717359447	5.2500 % KOMINS 5 1/4 04/16/25 REGS	2'000 USD	100.26%	1'733'948.32	0.31	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
CNY	1 = CHF	0.12131288
COP	1'000 = CHF	0.19594000
CZK	100 = CHF	3.70883500
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
HUF	100 = CHF	0.22992000
IDR	10'000 = CHF	0.55090000
ILS	1 = CHF	0.23114758
JPY	100 = CHF	0.56766800
KRW	1 = CHF	0.00062659
MXN	1 = CHF	0.04315732
MYR	1 = CHF	0.19746517
NOK	100 = CHF	7.83924400
NZD	1 = CHF	0.51462621
PLN	1 = CHF	0.21573275
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
THB	100 = CHF	2.56245400
USD	1 = CHF	0.86470000

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	49'154'510.55	27.459
Bond	CHF	128'335'027.43	71.692
Equity	CHF	661'802.92	0.370
Index bond	CHF	858'681.56	0.480
Total	CHF	179'010'022.46	100.000

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	18'968'529.09	3.453
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	329'868'680.37	60.050

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NT USD	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	167'215'059.43
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

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	0.950	1.200	0.750	0.200	2.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NT USD	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Bloomberg Global Treasury TR Index Unhedged CHF

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Ja	CHF	0.65000	0.22750	0.42250

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Ja	CHF	1.077	0.376	0.701
NT CHF	Ja	CHF	21.293	7.452	13.841
NT USD	Ja	CHF	1.574	0.550	1.024
NTH1 CHF	Ja	CHF	1.548	0.541	1.007

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

8 Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'217'550'246.58	1'005'734'992.77	555'463'493.54	481'962'050.16
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		324'079.55	312'910.49	347'532.07	17'722.90
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'041.895	4'124.042	181.241
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		80.1801	77.4168	84.2698	97.7864
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		80.2442	77.4710	84.4046	97.8450
Thesaurierung je Anteil		1.55	0.88	0.88	0.95
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'360'617.24	10'076'863.08	9'681'775.34	14'095'093.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		84'868.568	120'411.940	106'347.351	133'504.311
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.7296	83.6866	91.0392	105.5778
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		86.7990	83.7452	91.1848	105.6412
Thesaurierung je Anteil		1.77	1.04	1.05	1.15
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'386'788.99	23'580'947.40	114'019'753.23	120'816'266.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		112'951.900	296'761.300	1'380'846.600	1'248'562.500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		83.1043	79.4610	82.5724	96.7643
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		83.1708	79.5166	82.7045	96.8224
Thesaurierung je Anteil		1.69	0.99	0.96	1.05
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'106.38	7'801.94	8'466.51	9'793.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000	100.000	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		81.0638	78.0194	84.6651	97.9332
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.1287	78.0740	84.8006	97.9920
Thesaurierung je Anteil		1.97	1.29	1.34	1.45
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		741'351'549.60	688'038'351.48	173'299'082.85	143'953'372.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		807'649.928	778'834.784	180'766.822	129'811.681
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		917.9120	883.4202	958.6886	1'108.9401
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		918.6463	884.0386	960.2225	1'109.6054
Thesaurierung je Anteil		22.39	14.67	15.28	16.58
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		438'488'724.41	259'310'603.04	230'454'318.61	170'209'966.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'044'402.212	3'126'049.327	2'687'892.858	1'698'150.997
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.9258	82.9515	85.7379	100.2325
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		86.9953	83.0096	85.8751	100.2927
Thesaurierung je Anteil		2.11	1.38	1.37	1.49
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse Swiss Red Cross					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'630'380.41	24'407'515.34	27'652'564.93	32'859'835.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		269'023.894	327'248.144	337'797.274	343'467.199
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		76.6861	74.5841	81.8614	95.6710
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		76.7474	74.6363	81.9924	95.7284
Ausschüttung je Anteil		1.35	0.70	0.80	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %	0.70 %	0.70 %

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 DT CHF	3.97 %	-4.42 %	-14.68 %	-12.79 %
Klasse GT CHF	4.08 %	-4.33 %	-14.59 %	-12.71 %
Klasse GTH1 CHF	5.03 %	1.66 %	-13.53 %	-14.17 %
Klasse MT CHF	4.50 %	-3.88 %	-14.25 %	-12.28 %
Klasse NT CHF	4.49 %	-3.94 %	-14.25 %	-12.42 %
Klasse NTH1 CHF	5.38 %	2.19 %	-13.02 %	-13.89 %
Klasse Swiss Red Cross	3.78 %	-4.55 %	-14.85 %	-12.79 %
Benchmark Hedge	5.08 %	2.52 %	-	-
Benchmark	4.09 %	-3.83 %	-14.96 %	-1.77 %
Tracking Error 33)	0.36 %	0.48 %	1.15 %	0.43 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	-0.12 %
Klasse GT CHF	-0.01 %
Klasse GTH1 CHF	-0.05 %
Klasse MT CHF	0.41 %
Klasse NT CHF	0.40 %
Klasse NTH1 CHF	0.30 %
Klasse Swiss Red Cross	-0.31 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	93'171'473.24	115'492'262.59
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'118'292'349.46	923'722'696.96
Derivative Finanzinstrumente	-3'072'627.02	-16'854'030.06
Sonstige Vermögenswerte	9'177'426.28	7'147'517.71
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'217'568'621.96	1'029'508'447.20
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-23'745'397.69
Andere Verbindlichkeiten	-18'375.38	-28'056.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'217'550'246.58	1'005'734'992.77

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'041.895	4'124.042
Ausgegebene Anteile		-	17.744
Zurückgenommene Anteile		-	-99.891
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'041.895
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		120'411.940	106'347.351
Ausgegebene Anteile		22'014.346	31'169.832
Zurückgenommene Anteile		-57'557.718	-17'105.243
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		84'868.568	120'411.940
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		296'761.300	1'380'846.600
Ausgegebene Anteile		49'282.200	224'764.100
Zurückgenommene Anteile		-233'091.600	-1'308'849.400
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		112'951.900	296'761.300
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		778'834.784	180'766.822
Ausgegebene Anteile		153'096.837	633'914.962
Zurückgenommene Anteile		-124'281.693	-35'847.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		807'649.928	778'834.784
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'126'049.327	2'687'892.858
Ausgegebene Anteile		3'392'035.190	1'016'698.809
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		242'249.317	-
Zurückgenommene Anteile		-1'715'931.622	-578'542.340
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'044'402.212	3'126'049.327
Klasse Swiss Red Cross			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		327'248.144	337'797.274
Ausgegebene Anteile		2'588.000	2'119.337
Zurückgenommene Anteile		-60'812.250	-12'668.467
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		269'023.894	327'248.144

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	07.10.2024	21'248'874.62	242'249.317

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'005'734'992.77	555'463'493.54
Ausbezahlte Ausschüttung		-227'516.18	-268'887.28
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'899'187.88	-5'174'003.63
Saldo aus dem Anteilverkehr		167'099'495.05	516'976'238.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		50'842'462.82	-61'261'848.65
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'217'550'246.58	1'005'734'992.77

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		363'681.33	133'365.60
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-271'878.68	-341'695.59
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		26'963'085.46	15'541'583.62
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		6'311'081.97	1'771'420.98
Total Ertrag		33'365'970.08	17'104'674.61
Aufwand			
Passivzinsen		-3.99	-2'545.10
Reglementarische Vergütungen		-260'010.75	-319'781.38
Sonstige Aufwendungen		-1.60	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-3'648'064.85	-381'185.21
Total Aufwand		-3'908'081.19	-703'511.69
Nettoertrag / Verlust		29'457'888.89	16'401'162.92
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-26'222'520.22	-53'513'519.58
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		343'476.34	944'833.62
Realisierter Erfolg		3'578'845.01	-36'167'523.04
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		47'263'617.81	-25'094'325.61
Gesamterfolg		50'842'462.82	-61'261'848.65

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	6'298.69	3'564.65
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'298.69	3'564.65
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'204.54	1'247.63
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'094.15	2'317.02
Total	6'298.69	3'564.65
Klasse GT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	150'369.44	125'318.57
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	150'369.44	125'318.57
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	52'629.30	43'861.50
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	97'740.14	81'457.07
Total	150'369.44	125'318.57
Klasse GTH1 CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	191'536.00	296'121.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	191'536.00	296'121.45
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	67'037.60	103'642.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	124'498.40	192'478.94
Total	191'536.00	296'121.45
Klasse MT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	197.72	129.49
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	197.72	129.49
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	69.20	45.32
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	128.52	84.17
Total	197.72	129.49
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	18'084'449.25	11'425'569.62
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'084'449.25	11'425'569.62
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'329'557.24	3'998'949.37
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	11'754'892.01	7'426'620.25
Total	18'084'449.25	11'425'569.62
Klasse NTH1 CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	10'665'981.47	4'323'847.67
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'665'981.47	4'323'847.67
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'733'093.51	1'513'346.68
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'932'887.96	2'810'500.99
Total	10'665'981.47	4'323'847.67
Klasse Swiss Red Cross	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	359'056.32	226'611.47
Vortrag des Vorjahres	8'408.43	10'870.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	367'464.75	237'482.13
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	181'591.13	114'536.85
Zur Ausschüttung an das Schweizerische Rote Kreuz vorgesehener Erfolg	181'591.13	114'536.85
Vortrag auf neue Rechnung	4'282.49	8'408.43
Total	367'464.75	237'482.13

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'118'292'349.46	91.85	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'118'292'349.46	91.85	
XS2466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	96.19%	1'805'908.83	0.15	a)
XS2865538776	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/29 EMTN	0	9'150	4'150	5'000 USD	99.79%	4'314'463.89	0.35	a)
AE							6'120'372.72	0.50	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US676167BX63	3.1250 % OKB 3 1/8 11/07/23	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	6'500	0	0	6'500 AUD	76.79%	2'826'809.25	0.23	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	3'750	5'750	2'500	7'000 AUD	99.81%	3'956'958.08	0.32	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	2'000	0	0	2'000 AUD	52.62%	596'056.73	0.05	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	500	0	0	500 AUD	94.17%	266'670.82	0.02	a)
AU3CB0272888	1.6000 % SGOPT 1.6 07/01/25 MTN	500	0	0	500 AUD	97.77%	276'882.63	0.02	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	2'000	0	0	2'000 AUD	96.56%	1'093'824.14	0.09	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'550	0	0	1'550 AUD	82.18%	721'403.38	0.06	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	7'250	0	0	7'250 AUD	71.99%	2'956'044.08	0.24	a)
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05252BDK26	5.9243 % ANZ FLOAT 03/18/26 REGS	0	7'500	0	7'500 USD	100.17%	6'496'274.93	0.53	a)
US05253JAL52	3.7000 % ANZ 3.7 11/16/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.15%	857'358.70	0.07	a)
US05253JAX90	5.3750 % ANZ 5 3/8 07/03/25	1'900	1'100	0	3'000 USD	100.51%	2'607'200.21	0.21	a)
US05253JAY73	5.6710 % ANZ 5.671 10/03/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55608PBE34	2.3000 % MQGAU 2.3 01/22/25 144A	0	1'217	0	1'217 USD	99.38%	1'045'794.35	0.09	a)
US55608PBJ21	3.2310 % MQGAU 3.231 03/21/25 144A	0	1'918	0	1'918 USD	99.32%	1'647'216.84	0.14	a)
US55608RBE99	2.3000 % MQGAU 2.3 01/22/25 REGS	0	1'090	0	1'090 USD	99.38%	936'660.51	0.08	a)
US55608RBJ86	3.2310 % MQGAU 3.231 03/21/25 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	99.32%	858'820.04	0.07	a)
US961214FH19	5.3500 % WSTP 5.35 10/18/24	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
AU							27'143'974.69	2.23	
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	0	8'750	8'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	0	8'000	0	8'000 EUR	62.84%	4'719'102.28	0.39	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	5'500	0	1'500	4'000 EUR	96.15%	3'610'428.29	0.30	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	2'400	1'400	1'000 EUR	98.96%	929'033.13	0.08	a)
BE0390160266	3.2900 % BPOST 3.29 10/16/29	0	3'000	0	3'000 EUR	99.72%	2'808'277.79	0.23	a)
BE0390161272	3.6320 % BPOST 3.632 10/16/34	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	11'000	0	11'000 USD	98.39%	9'358'466.51	0.77	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	2'900	2'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6355215664	3.5000 % LONNVX 3 1/2 09/04/34	0	3'000	0	3'000 EUR	99.22%	2'794'224.57	0.23	a)
BE							24'219'532.57	1.99	
CA07813ZBZ68	3.3500 % BCECN 3.35 03/12/25 MTN	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	5'000	750	0	5'750 CAD	76.01%	2'711'134.89	0.22	a)
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	0	150	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA110709GC03	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/44	1'000	0	0	1'000 CAD	85.93%	533'031.61	0.04	a)
CA110709GJ55	2.9500 % BRCOL 2.95 06/18/50	3'000	0	0	3'000 CAD	79.63%	1'481'928.12	0.12	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	750	0	0	750 CAD	90.90%	422'896.27	0.03	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	0	1'800	900	900 CAD	99.36%	554'740.45	0.05	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	3'300	4'750	4'550	3'500 CAD	85.82%	1'863'352.66	0.15	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	7'500	0	7'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	0	8'850	8'850	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	1'000	0	0	1'000 CAD	71.42%	443'016.46	0.04	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	3'000	3'250	5'250	1'000 CAD	96.46%	598'376.49	0.05	a)
CA135087R481	3.0000 % CAN 3 06/01/34	0	5'000	0	5'000 CAD	98.23%	3'046'688.05	0.25	a)
CA135087R713	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/34	0	4'000	0	4'000 CAD	102.30%	2'538'388.74	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA136375CX83	3.0500 % CNRCN 3.05 02/08/50	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA44810ZBZ23	3.0200 % HYDONE 3.02 04/05/29 MTN	1'250	0	0	1'250 CAD	97.77%	758'074.14	0.06 a)	
CA68333ZAN74	1.3500 % ONT 1.35 12/02/30	3'000	0	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	6'300	0	3'300	3'000 CAD	92.04%	1'712'911.80	0.14 a)	
CA68333ZAY30	3.6500 % ONT 3.65 06/02/33	0	1'000	0	1'000 CAD	99.14%	615'013.57	0.05 a)	
CA68333ZBH97	4.1000 % ONT 4.1 10/07/54	0	3'500	0	3'500 CAD	98.80%	2'144'970.24	0.18 a)	
CA69363TAN24	2.0500 % PSPCAP 2.05 01/15/30 12	3'000	0	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZFM01	2.1000 % Q 2.1 05/27/31	3'500	0	0	3'500 CAD	91.92%	1'995'770.03	0.16 a)	
CAC69798AZ64	4.3000 % ONTFT 4.3 06/02/34	0	5'000	0	5'000 CAD	102.75%	3'186'757.11	0.26 a)	
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	6'000	0	0	6'000 CAD	102.69%	3'821'875.36	0.31 a)	
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	6'900	0	6'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US013051EH65	1.8750 % ALTA 1 7/8 11/13/24	0	8'000	0	8'000 USD	99.90%	6'910'544.05	0.57 a)	
US06368D3S13	3.7000 % BMO 3.7 06/07/25 MTN	3'000	0	0	3'000 USD	99.34%	2'577'030.82	0.21 a)	
US110709AD48	1.7500 % BRCOL 1 3/4 09/27/24 10	4'000	1'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AN20	4.7500 % BRCOL 4 3/4 06/12/34	0	12'000	0	12'000 USD	100.67%	10'445'610.59	0.86 a)	
US11070TAM09	4.2000 % BRCOL 4.2 07/06/33	10'000	0	0	10'000 USD	97.02%	8'389'405.87	0.69 a)	
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	0	10'000	0	10'000 USD	99.21%	8'578'861.64	0.70 a)	
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22411WAZ95	4.2500 % CPPIBC 4 1/4 07/20/28 REGS	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BKF84	4.7500 % EDC 4 3/4 06/05/34	0	4'400	0	4'400 USD	102.83%	3'912'276.35	0.32 a)	
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	3'900	0	0	3'900 USD	89.79%	3'027'846.49	0.25 a)	
US683234AR91	1.1250 % ONT 1 1/8 10/07/30	5'161	0	0	5'161 USD	82.85%	3'697'226.90	0.30 a)	
US68323AFC36	3.0500 % ONT 3.05 01/29/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68323AFH23	1.6000 % ONT 1.6 02/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	84.16%	3'638'830.54	0.30 a)	
US69376QA05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	5'000	3'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69376QB87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748148SC86	0.6000 % Q 0.6 07/23/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	7'000	1'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZW32	5.1500 % RY 5.15 02/01/34 GMTN	0	6'785	0	6'785 USD	100.59%	5'901'839.42	0.48 a)	
US78017FZQ98	4.5100 % RY 4.51 10/18/27 GMTN	0	2'210	0	2'210 USD	99.70%	1'905'234.93	0.16 a)	
US78017FZT38	4.6500 % RY 4.65 10/18/30 GMTN	0	3'270	0	3'270 USD	99.00%	2'799'406.41	0.23 a)	
US89114QCB23	3.2500 % TD 3 1/4 03/11/24 GMTN	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZE53	0.7000 % TD 0.7 09/10/24 MTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AK75	0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 REGS	0	10'000	6'000	4'000 USD	97.79%	3'382'464.28	0.28 a)	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	94.83%	2'460'036.91	0.20 a)	
USC23264AX96	4.8750 % CADEPO 4 7/8 06/05/29 REGS	0	3'100	0	3'100 USD	101.87%	2'730'777.08	0.22 a)	
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	5'800	0	5'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	3'700	3'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC8888MBN77	4.7010 % TD 4.701 06/05/26 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2305736543	0.0500 % CPPIBC 0.05 02/24/31 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	84.04%	4'733'822.02	0.39 a)	
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	1'850	0	0	1'850 AUD	89.77%	940'641.70	0.08 a)	
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	550	0	550	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2411135150	0.9500 % ONTFT 0.95 11/24/51 EMTN	500	0	0	500 EUR	57.77%	271'160.44	0.02 a)	
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	100.54%	1'117'715.87	0.09 a)	
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2803424329	3.5630 % TD 3.563 04/16/31 GMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2895482201	2.8620 % TD 2.862 04/15/31	0	12'000	6'000	6'000 EUR	100.31%	5'650'181.91	0.46 a)	
CA							111'499'840.21	9.16	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	3'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	1'000	750	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	2'000	0	2'000 CHF	99.90%	1'998'000.00	0.16 a)	
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	0	3'000	0	3'000 CHF	99.70%	2'991'000.00	0.25 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	0	4'000	1'500	2'500 CHF	99.65%	2'491'250.00	0.20	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	1'000	1'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	1'000	750	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	2'000	0	1'500	500 CHF	98.20%	491'000.00	0.04	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	2'925	0	2'925 EUR	102.23%	2'807'156.91	0.23	a)
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22550UAF84	6.6186 % UBS FLOAT 02/21/25 FRN	0	4'000	0	4'000 USD	100.21%	3'466'132.66	0.28	a)
USH42097CU99	3.1790 % UBS 3.179 02/11/43 REGS	4'000	0	1'600	2'400 USD	74.19%	1'539'629.48	0.13	a)
CH							15'784'169.05	1.30	
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	3'000	0	0	3'000 USD	74.26%	1'926'274.90	0.16	a)
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	0	1'225	1'225	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	0	1'650	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	0	6'500	3'000	3'500 EUR	98.27%	3'228'944.93	0.27	a)
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	99.08%	1'124'868.20	0.09	a)
XS2856800938	3.8750 % CHILE 3 7/8 07/09/31	0	3'000	0	3'000 EUR	101.48%	2'857'872.41	0.23	a)
CL							9'137'960.44	0.75	
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	101.03%	2'451'151.00	0.20	a)
CN							2'451'151.00	0.20	
CZ0001005037	0.2500 % CZGB 0 1/4 02/10/27 100	30'000	0	10'000	20'000 CZK	92.68%	687'484.49	0.06	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	0	40'000	10'000	30'000 CZK	84.67%	942'025.55	0.08	a)
CZ							1'629'510.04	0.13	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	0	30'150	18'150	12'000 EUR	99.37%	11'194'471.84	0.92	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	0	5'000	2'000	3'000 EUR	90.23%	2'540'985.03	0.21	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	0	14'000	14'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	8'500	0	8'500 EUR	77.64%	6'195'403.56	0.51	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	0	7'500	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	0	12'000	0	12'000 EUR	49.59%	5'586'027.14	0.46	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	2'000	14'500	16'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	0	6'000	3'500	2'500 EUR	82.34%	1'932'411.25	0.16	a)
DE000A1RQEXO	2.6250 % HESSEN 2 5/8 08/25/34	0	10'000	4'000	6'000 EUR	99.05%	5'579'099.10	0.46	a)
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	9'000	5'500	3'500 EUR	101.89%	3'347'622.80	0.27	a)
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MK0	0.0000 % NRW 0 01/15/29	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	85.25%	800'282.38	0.07	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CW79	5.4140 % DB 5.414 05/10/29	0	10'000	0	10'000 USD	101.49%	8'775'407.95	0.72	a)
US30254WAP41	2.7500 % FMSWER 2 3/4 01/30/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	1'225'000	0	0	1'225'000 JPY	102.18%	7'105'806.90	0.58	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	500'000	0	0	500'000 JPY	119.29%	3'385'940.94	0.28	a)
US500769GK42	2.5000 % KFW 2 1/2 11/20/24	5'000	3'000	0	8'000 USD	99.88%	6'908'953.00	0.57	a)
US500769JR67	1.2500 % KFW 1 1/4 01/31/25	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110CE22	5.0000 % RENTEN 5 10/24/33 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	104.45%	1'806'427.48	0.15	a)
XS1551675488	2.3750 % RENTEN 2 3/8 01/23/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	6'000	1'600	0	7'600 EUR	83.72%	5'973'201.26	0.49	a)
XS2307309893	1.0000 % RENTEN 1 02/25/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	90.22%	3'900'661.70	0.32	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	20'000	45'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	0	8'000	0	8'000 EUR	83.67%	6'283'299.53	0.52	a)
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS2451376219	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 03/03/34 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	86.03%	4'037'976.54	0.33	a)
XS2590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 CNY	101.04%	12'257'453.40	1.01	a)
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2844398482	4.2500 % SDFGR 4 1/4 06/19/29	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2924823532	4.0000 % LBANK 4 01/22/27 EMTN	0	8'000	0	8'000 USD	99.47%	6'880'867.54	0.57	a)
DE							104'492'299.34	8.58	
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	6'750	0	0	6'750 DKK	92.73%	787'802.18	0.06	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	5'500	0	0	5'500 DKK	99.91%	691'645.46	0.06	a)
DK0009924375	0.0000 % DGB 0 11/15/31 G	7'000	0	0	7'000 DKK	86.71%	763'930.88	0.06	a)
XS2615916850	3.3750 % KOMMUN 3 3/8 04/26/43 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	104.01%	1'171'728.53	0.10	a)
DK							3'415'107.05	0.28	
XS2181347183	0.1250 % ESTONI 0 1/8 06/10/30	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EE							0.00	0.00	
AU3CB0297596	5.6780 % SANTAN 5.678 03/09/28 FXD	2'850	0	0	2'850 AUD	100.92%	1'628'948.46	0.13	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	2'000	5'000	0	7'000 EUR	56.65%	3'722'516.08	0.31	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	12'000	3'000	2'000	13'000 EUR	74.70%	9'116'407.48	0.75	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	12'000	4'000	9'000	7'000 EUR	85.67%	5'629'313.30	0.46	a)
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 EUR	101.79%	4'778'000.00	0.39	a)
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	100'000	0	0	100'000 JPY	99.96%	567'429.58	0.05	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	6'000	0	6'000 USD	101.52%	5'267'008.76	0.43	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HBF10	5.3650 % SANTAN 5.365 07/15/28	0	7'600	0	7'600 USD	100.85%	6'627'513.90	0.54	a)
US05964HBG92	5.4390 % SANTAN 5.439 07/15/31	0	4'000	0	4'000 USD	101.59%	3'513'725.74	0.29	a)
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	5'000	1'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	0	5'500	1'500	4'000 GBP	90.67%	4'032'097.09	0.33	a)
XS2634826031	4.2500 % SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN	4'100	0	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2926265765	2.6500 % ICO 2.65 10/30/34 EMTN	0	50'000	10'000	40'000 CNY	95.58%	4'638'034.03	0.38	a)
ES							49'520'994.42	4.07	
XS1964628991	2.5000 % KUNTA 2 1/2 11/15/23 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2289129483	0.6250 % KUNTA 0 5/8 03/20/26 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	94.93%	8'208'597.10	0.67	a)
XS2914674408	3.6250 % KUNTA 3 5/8 10/09/29 REGS	0	4'800	0	4'800 USD	97.25%	4'036'378.09	0.33	a)
FI							12'244'975.19	1.01	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002S57	0.0100 % BFCM 0.01 05/11/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	95.79%	4'495'949.96	0.37	a)
FR0014003CJ5	0.8750 % SOGRPR 0 7/8 05/10/46 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	0	900	0	900 EUR	83.03%	701'497.74	0.06	a)
FR0014006OB0	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	53.92%	506'178.67	0.04	a)
FR00140095D5	0.5000 % CFF 0 1/2 03/16/28 EMTN	4'000	1'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 OAT	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54 OAT	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I3C5	3.4700 % BNFP 3.47 05/22/31 EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I4X9	4.1250 % BNP 4 1/8 05/24/33 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	3'000	0	0	3'000 EUR	103.31%	2'909'466.58	0.24	a)
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	5'900	0	5'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	6'200	0	6'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	0	2'800	0	2'800 EUR	101.38%	2'664'903.05	0.22	a)
FR001400NCB6	5.7500 % SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN	0	1'600	1'600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400P8C5	4.0000 % TISSEO 4 04/08/39 EMTN	0	5'900	3'900	2'000 EUR	98.06%	1'841'074.73	0.15	a)
FR001400Q0T5	3.5000 % BFCM 3 1/2 05/15/31 EMTN	0	8'000	0	8'000 EUR	101.06%	7'589'525.89	0.62	a)
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	800'000	0	0	800'000 JPY	99.63%	4'524'586.44	0.37	a)
JP525020CQAO	1.5630 % BFCM 1.563 10/13/34 46	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.04%	5'622'354.17	0.46	a)
JP525021APCO	0.8950 % BPCEGP 0.895 12/14/26 36	0	600'000	600'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP525022AQ16	0.7240 % ACAFP 0.724 01/26/27 22	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.61%	5'654'370.65	0.46	a)
JP525022CP64	1.2330 % ACAFP 1.233 06/13/33 21	0	200'000	0	200'000 JPY	98.75%	1'121'178.36	0.09	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	3'785	0	3'785	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05581LAG41	5.8940 % BNP 5.894 12/05/34 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06675GAZ81	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 REGS	0	2'739	2'739	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659X2P63	2.8710 % BNP 2.871 04/19/32 REGS	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659X2Q47	1.6750 % BNP 1.675 06/30/27 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	94.74%	4'915'300.68	0.40	a)
US09659X2U58	5.1250 % BNP 5 1/8 01/13/29 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	100.51%	4'345'593.09	0.36	a)
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	2'250	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1046806821	3.3750 % CADES 3 3/8 03/20/24 REGS	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2345996230	0.3750 % CADES 0 3/8 05/27/24 REGS	5'000	2'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FR							46'891'980.01	3.85	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	200	0	0	200 AUD	99.64%	112'865.64	0.01	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	250	0	250	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	2'750	0	0	2'750 GBP	43.42%	1'327'427.25	0.11	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	1'300	200	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	4'450	2'450	2'000 GBP	99.00%	2'201'057.92	0.18	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	6'500	4'250	0	10'750 GBP	63.97%	7'645'041.00	0.63	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	7'100	4'400	2'000	9'500 GBP	74.84%	7'904'292.59	0.65	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'500	0	2'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	5'000	6'000	0	11'000 GBP	38.71%	4'733'124.98	0.39	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	3'500	3'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	3'000	2'100	0	5'100 GBP	67.63%	3'834'176.41	0.31	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	0	4'000	0	4'000 USD	85.37%	2'952'915.91	0.24	a)
US046353AX64	2.1250 % AZN 2 1/8 08/06/50	2'000	2'000	0	4'000 USD	57.04%	1'972'899.52	0.16	a)
US06738EAN58	4.3750 % BACR 4 3/8 01/12/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06739FHV67	3.7500 % BACR 3 3/4 05/15/24 BKNT	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US539439AV19	2.4380 % LLOYDS 2.438 02/05/26	3'000	0	0	3'000 USD	99.26%	2'574'825.84	0.21	a)
US53944YAS28	3.7500 % LLOYDS 3 3/4 03/18/28	6'000	0	0	6'000 USD	97.35%	5'050'764.58	0.41	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63861WAK18	5.1270 % NWDI 5.127 07/29/29 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	100.63%	8'701'562.57	0.71	a)
US639057AL28	5.5830 % NWG 5.583 03/01/28	0	1'675	1'675	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AS70	4.9640 % NWG 4.964 08/15/30	0	4'000	0	4'000 USD	99.13%	3'428'604.68	0.28	a)
USG6382GVA77	0.8000 % NWG 0.8 08/12/24 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG6398ADD66	5.2640 % NWDI 5.264 11/10/26 REGS	0	7'500	1'000	6'500 USD	101.44%	5'701'261.10	0.47	a)
XS0222383027	4.0000 % GSK 4 06/16/25 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	6'000	5'500	6'000	5'500 USD	95.05%	4'520'482.98	0.37	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	0	200'000	0	200'000 JPY	98.28%	1'115'774.16	0.09	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	94.91%	1'231'082.04	0.10	a)
XS2445344570	2.6250 % SVTLN 2 5/8 02/22/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2462446696	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/29/38 EMTN	550	0	550	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2574870759	3.5000 % MOTOPG 3 1/2 07/17/31 EMTN	6'000	0	2'000	4'000 EUR	100.21%	3'762'732.50	0.31	a)
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	2'500	2'500	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	2'000	3'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	4'800	0	800	4'000 EUR	103.73%	3'895'210.12	0.32	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	1'800	0	1'800 GBP	103.68%	2'074'781.96	0.17	a)
XS2741906809	5.3500 % NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN	0	1'550	0	1'550 GBP	95.13%	1'639'203.39	0.13	a)
XS2742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	97.01%	1'078'483.92	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52838520836	5.7500 % MOTOPG 5 3/4 06/17/51 EMTN	0	900	0	900 GBP	98.70%	987'554.51	0.08	a)
X52838538374	4.2500 % MOTOPG 4 1/4 06/17/35 EMTN	0	7'776	0	7'776 EUR	104.20%	7'606'451.49	0.62	a)
X52892335394	5.6250 % BRITEL 5 5/8 12/03/41 EMTN	0	1'600	1'600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB							86'052'577.06	7.07	
HK0001031944	3.3750 % HKINTL 3 3/8 07/24/31 GMTN	0	5'100	5'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HK0001031969	2.8000 % HKINTL 2.8 07/24/34 GMTN	0	21'000	0	21'000 CNY	102.04%	2'599'642.82	0.21	a)
JP534411AK62	0.2040 % HSBC 0.204 06/25/24 3	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
HK							2'599'642.82	0.21	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	3'400	0	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52828685631	5.7500 % GLJGR 5 3/4 07/06/29 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52905582479	5.1250 % GLJGR 5 1/8 01/04/29 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE							0.00	0.00	
X52293755125	0.0000 % ICELND 0 04/15/28	0	4'000	0	4'000 EUR	90.86%	3'411'862.06	0.28	a)
X52779814750	5.0000 % LANBNN 5 05/13/28 EMTN	0	1'650	1'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52788435050	3.5000 % ICELND 3 1/2 03/21/34	0	3'450	3'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52792180197	4.6250 % ISLBAN 4 5/8 03/27/28	0	3'400	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52913946989	3.7500 % LANBNN 3 3/4 10/08/29 EMTN	0	10'000	0	10'000 EUR	99.30%	9'321'967.47	0.77	a)
IS							12'733'829.53	1.05	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	0	10'000	8'000	2'000 EUR	79.68%	1'496'062.14	0.12	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	3'500	0	1'500	2'000 EUR	72.85%	1'367'827.71	0.11	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	0	1'000	0	1'000 EUR	84.27%	791'082.54	0.06	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	0	2'500	0	2'500 EUR	91.92%	2'157'361.30	0.18	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005570988	4.6000 % UCIGIM 4.6 02/14/30 EMTN	0	6'250	6'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	9'000	0	9'000 EUR	102.95%	8'698'237.43	0.71	a)
X52311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	1'300'000	0	1'300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52433139966	0.9250 % UCIGIM 0.925 01/18/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.77%	5'663'396.57	0.47	a)
X52630420268	6.6250 % ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52783772614	1.2730 % ISPIM 1.273 03/13/26 EMTN	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.64%	5'656'187.19	0.46	a)
IT							25'830'154.88	2.12	
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.59%	1'130'658.42	0.09	a)
JP316572BMA4	0.1000 % NTT 0.1 09/18/26 21	200'000	0	0	200'000 JPY	98.95%	1'123'369.56	0.09	a)
JP316572BQA5	0.9230 % NTT 0.923 12/20/29 36	0	500'000	0	500'000 JPY	100.05%	2'839'787.55	0.23	a)
US62954WAC91	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 144A	8'000	2'000	7'000	3'000 USD	95.22%	2'470'179.84	0.20	a)
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	8'640	3'500	5'140 USD	100.94%	4'486'514.63	0.37	a)
X50241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP							12'050'510.00	0.99	
AU3C80314748	5.0500 % SHINCA 5.05 10/22/27 MTN	0	3'000	0	3'000 AUD	99.70%	1'694'004.11	0.14	a)
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	5'000'000	0	0	5'000'000 KRW	98.56%	3'087'820.03	0.25	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	5'000'000	0	0	5'000'000 KRW	84.18%	2'637'244.44	0.22	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	1'000'000	0	0	1'000'000 KRW	83.16%	521'042.37	0.04	a)
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	75.00%	1'409'877.77	0.12	a)
KR103502GAC2	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/30 3012	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	91.04%	1'711'435.36	0.14	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	5'000'000	2'500'000	0	7'500'000 KRW	101.00%	4'746'193.27	0.39	a)
US500630CW64	3.2500 % KDB 3 1/4 02/19/24	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DB19	1.7500 % KDB 1 3/4 02/18/25 GMTN	0	8'000	0	8'000 USD	99.01%	6'848'839.06	0.56	a)
US500630DF23	0.4000 % KDB 0.4 06/19/24	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DT27	4.0000 % KDB 4 09/08/25	2'345	0	0	2'345 USD	99.22%	2'011'966.10	0.17	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	4'300	0	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2623871196	3.3750 % KDB 3 3/8 05/23/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	101.33%	2'853'704.32	0.23	a)
XS2740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	0	5'000	2'000	3'000 EUR	101.02%	2'845'030.19	0.23	a)
XS2775400703	5.5000 % SHINCA 5 1/2 03/12/29	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2895635121	2.8000 % KDB 2.8 09/05/34 EMTN	0	25'000	0	25'000 CNY	99.80%	3'026'695.70	0.25	a)
KR							33'393'852.72	2.74	
XS2487342649	2.1250 % LITHUN 2 1/8 06/01/32 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LT							0.00	0.00	
EU000A25CAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A25CAM1	2.6250 % EFSF 2 5/8 07/16/29 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2020670852	1.0000 % MDT 1 07/02/31	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2150006562	2.2000 % DE 2.2 04/02/32 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	93.74%	5'279'897.94	0.43	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2447550893	3.0000 % PRIFII 3 02/22/42 EMTN	450	0	450	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2847688251	4.3750 % PRIFII 4 3/8 07/01/36 EMTN	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							5'279'897.94	0.43	
XS2317123052	0.0000 % LATVIA 0 03/17/31 GMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	82.08%	1'541'122.56	0.13	a)
LV							1'541'122.56	0.13	
US02364WBE49	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 07/16/42	3'000	0	0	3'000 USD	86.25%	2'237'385.31	0.18	a)
US02364WBJ36	2.8750 % AMXLMM 2 7/8 05/07/30	6'000	0	0	6'000 USD	89.77%	4'657'291.49	0.38	a)
MX							6'894'676.80	0.57	
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	2'500	0	0	2'500 AUD	97.40%	1'379'117.49	0.11	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	2'000	0	0	2'000 AUD	94.52%	1'070'625.28	0.09	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US21688AAQ58	0.3750 % RABOBK 0 3/8 01/12/24	0	3'477	3'477	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21688ABH41	4.4940 % RABOBK 4.494 10/17/29	0	15'000	0	15'000 USD	98.76%	12'809'665.80	1.05	a)
US82620KAZ66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN82008AL29	2.3500 % SIEGR 2.35 10/15/26 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	96.11%	1'662'057.16	0.14	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	83.04%	3'897'585.18	0.32	a)
XS2182093943	1.0000 % BNG 1 06/03/30 REGS	5'440	5'000	440	10'000 USD	83.44%	7'215'316.21	0.59	a)
XS2204965540	0.2500 % NEDWBK 0 1/4 12/15/25 EMTN	2'250	0	0	2'250 GBP	95.13%	2'379'563.84	0.20	a)
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	0	8'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	7'250	0	0	7'250 EUR	80.30%	5'465'490.53	0.45	a)
XS2381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	7'500	1'200	4'700	4'000 EUR	90.92%	3'413'927.33	0.28	a)
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	1'350	0	1'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	0	7'000	1'700	5'300 EUR	98.59%	4'905'416.78	0.40	a)
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	3'800	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2913310095	3.0000 % ALLRNV 3 10/07/34 EMTN	0	5'500	3'500	2'000 EUR	98.37%	1'846'895.03	0.15	a)
NL							46'045'660.63	3.78	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	200	800	0	1'000 NOK	96.74%	75'837.63	0.01	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	1'300	1'700	0	3'000 NOK	94.10%	221'311.27	0.02	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	0	5'000	0	5'000 NOK	84.82%	332'462.34	0.03	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	2'300	0	0	2'300 NOK	96.25%	173'541.26	0.01	a)
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	14'000	3'000	4'000	13'000 USD	84.04%	9'446'683.21	0.78	a)
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	0	5'500	0	5'500 EUR	84.64%	4'370'315.89	0.36	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	4'000	1'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462667861	2.5000 % KBN 2 1/2 09/27/24 REGS	0	7'500	7'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2537112059	3.7500 % KBN 3 3/4 09/26/25 EMTN	3'000	0	1'500	1'500 GBP	99.06%	1'651'827.32	0.14	a)
XS2779793061	3.7500 % STATK 3 3/4 03/22/39 EMTN	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NO							16'271'978.92	1.34	
AU3CB0239754	2.9000 % AUCCCN 2.9 09/16/27 MTN	500	0	0	500 AUD	94.90%	268'752.26	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	5'250	0	5'250	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	3'500	0	0	3'500 NZD	88.22%	1'588'921.29	0.13	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	3'100	0	0	3'100 USD	101.89%	2'731'179.16	0.22	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	94.37%	2'448'129.99	0.20	a)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	84.47%	2'921'717.54	0.24	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	102.00%	3'527'803.06	0.29	a)
US96122QAB95	5.1320 % WSTPNZ 5.132 02/26/27 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	100.97%	8'730'616.49	0.72	a)
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	4'000	2'000	0	6'000 EUR	84.04%	4'733'484.07	0.39	a)
XS2381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	3'000	3'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2919279633	3.1850 % ASBBNK 3.185 04/16/29 EMTN	0	1'900	0	1'900 EUR	99.86%	1'781'055.19	0.15	a)
NZ							28'731'659.05	2.36	
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	14'500	0	14'500	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	8'000	8'500	0	16'500 SEK	100.03%	1'333'863.07	0.11	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	6'000	0	0	6'000 SEK	98.34%	476'832.16	0.04	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	6'000	5'000	0	11'000 SEK	96.16%	854'777.85	0.07	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	2'000	0	7'000 SEK	88.57%	501'025.06	0.04	a)
SE0015193313	0.5000 % SGB 0 1/2 11/24/45 #1063 1063	1'000	2'000	0	3'000 SEK	69.70%	168'984.23	0.01	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	20'000	0	20'000 SEK	97.17%	1'570'514.21	0.13	a)
USW8454EAT56	5.1250 % SEB 5 1/8 03/05/27 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	99.70%	1'697'877.96	0.14	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	1'500	0	0	1'500 SEK	89.85%	108'909.27	0.01	a)
XS2474788929	2.7500 % KOMINS 2 3/4 03/01/25 REGS	5'000	3'000	3'000	5'000 USD	99.36%	4'296'002.54	0.35	a)
XS2490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2496002614	3.2500 % KOMINS 3 1/4 01/16/24 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2717359447	5.2500 % KOMINS 5 1/4 04/16/25 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	100.26%	8'669'741.61	0.71	a)
SE							19'678'527.96	1.62	
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	0	3'000	3'000	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	8'500	3'500	5'000 USD	98.65%	4'265'219.22	0.35	a)
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	1'800	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	2'200	0	0	2'200 USD	95.74%	1'821'243.25	0.15	a)
SG							6'086'462.47	0.50	
JP570500EQ92	0.7500 % SLOVEN 0 3/4 09/03/27 1	0	1'200'000	0	1'200'000 JPY	99.91%	6'806'089.55	0.56	a)
XS0982709221	5.2500 % SLOVEN 5 1/4 02/18/24 REGS	0	1'849	1'849	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	3'400	6'600	2'000	8'000 USD	100.47%	6'949'974.37	0.57	a)
SI							13'756'063.92	1.13	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOPO 5 3/8 10/04/28 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK							0.00	0.00	
US001055AQ51	2.8750 % AFL 2 7/8 10/15/26	8'000	0	6'000	2'000 USD	96.90%	1'675'840.48	0.14	a)
US001055AY85	4.7500 % AFL 4 3/4 01/15/49	4'000	0	0	4'000 USD	89.60%	3'099'119.39	0.25	a)
US00206RCU41	5.6500 % T 5.65 02/15/47	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RKA94	3.6500 % T 3.65 06/01/51	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RML32	1.7000 % T 1.7 03/25/26	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YBZ16	2.6000 % ABBV 2.6 11/21/24	3'000	0	0	3'000 USD	99.85%	2'590'286.67	0.21	a)
US00287YDW66	5.4000 % ABBV 5.4 03/15/54	0	4'900	4'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00846UAM36	2.1000 % A 2.1 06/04/30	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	2'875	0	2'875 USD	101.27%	2'517'510.28	0.21	a)
US03040WAV72	4.1500 % AWK 4.15 06/01/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03040WAY12	2.3000 % AWK 2.3 06/01/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	2'000	3'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AN31	2.2500 % ELV 2 1/4 05/15/30	0	4'000	0	4'000 USD	87.06%	3'011'231.28	0.25	a)
US036752AS28	3.6000 % ELV 3.6 03/15/51	2'000	1'000	0	3'000 USD	72.41%	1'878'361.87	0.15	a)
US036752BB83	4.7500 % ELV 4 3/4 02/15/30	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AZ38	2.5000 % AAPL 2 1/2 02/09/25	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833CG39	3.0000 % AAPL 3 02/09/24	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAC74	0.7000 % AZN 0.7 05/28/24	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	3'000	2'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJE08	2.6760 % BAC 2.676 06/19/41 MTN	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJS93	1.7340 % BAC 1.734 07/22/27	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GKK49	2.9720 % BAC 2.972 02/04/33 MTN	3'500	6'500	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GKS74	3.8410 % BAC 3.841 04/25/25	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09247XAQ43	2.4000 % BLK 2.4 04/30/30	1'500	8'500	0	10'000 USD	89.19%	7'711'826.95	0.63	a)
US09290DAA90	4.7000 % BLK 4.7 03/14/29	0	3'200	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09290DAH44	4.6000 % BLK 4.6 07/26/27	0	3'200	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	5'000	0	0	5'000 USD	88.32%	3'818'385.50	0.31	a)
US126408HU08	4.1000 % CSX 4.1 11/15/32	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967MD09	4.6500 % C 4.65 07/23/48	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967PL97	5.4490 % C 5.449 06/11/35	0	4'000	0	4'000 USD	100.87%	3'488'753.21	0.29	a)
US17325FBA57	5.8640 % C 5.864 09/29/25	4'300	0	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	0	5'000	0	5'000 USD	86.95%	3'759'326.49	0.31	a)
US20030NCJ81	3.9000 % CMCSA 3.9 03/01/38	6'000	0	3'000	3'000 USD	86.27%	2'237'852.25	0.18	a)
US24422EXR51	4.9000 % DE 4.9 06/11/27 MTN	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBP50	4.3500 % DELL 4.35 02/01/30	0	10'000	0	10'000 USD	97.16%	8'401'511.67	0.69	a)
US254687CZ75	3.7000 % DIS 3.7 09/15/24	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36264FAL58	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/24/29	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40428HA448	5.2940 % HSBC 5.294 03/04/27	0	4'175	0	4'175 USD	101.40%	3'660'736.42	0.30	a)
US40428HA513	6.3054 % HSBC FLOAT 03/04/27	0	4'175	4'175	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAC90	3.4000 % HPQ 3.4 06/17/30	0	4'000	2'000	2'000 USD	92.39%	1'597'861.84	0.13	a)
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	4'900	0	4'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US42824CB570	4.4000 % HPE 4.4 09/25/27	0	2'150	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076BC57	3.7500 % HD 3 3/4 02/15/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200JH57	4.7000 % IBM 4.7 02/19/46	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PBH82	2.0050 % JPM 2.005 03/13/26	0	5'000	0	5'000 USD	98.86%	4'274'298.57	0.35	a)
US46647PBT21	1.0450 % JPM 1.045 11/19/26	0	5'000	0	5'000 USD	96.06%	4'152'981.16	0.34	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	5'000	0	5'000 USD	87.36%	3'776'923.13	0.31	a)
US46647PCZ71	4.0800 % JPM 4.08 04/26/26	0	5'000	0	5'000 USD	99.50%	4'301'968.97	0.35	a)
US46647PEQ54	4.6030 % JPM 4.603 10/22/30	0	1'700	0	1'700 USD	98.65%	1'450'159.83	0.12	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	3'000	0	0	3'000 USD	88.13%	2'286'232.21	0.19	a)
US532457CG18	4.8750 % LLY 4 7/8 02/27/53	0	2'000	0	2'000 USD	94.20%	1'629'129.39	0.13	a)
US532457CQ99	4.2000 % LLY 4.2 08/14/29	0	2'200	0	2'200 USD	98.70%	1'877'628.60	0.15	a)
US548661DV65	5.0000 % LOW 5 04/15/40	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EA10	2.6250 % LOW 2 5/8 04/01/31	0	6'000	0	6'000 USD	87.61%	4'545'278.26	0.37	a)
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'000	2'500	6'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	4'650	0	4'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571748BN17	2.2500 % MMC 2 1/4 11/15/30	0	5'000	0	5'000 USD	86.82%	3'753'835.64	0.31	a)
US57629W3S73	4.3500 % MASSMU 4.35 09/17/31 144A	0	12'000	0	12'000 USD	96.78%	10'042'487.45	0.82	a)
US57629W4S64	5.1000 % MASSMU 5.1 04/09/27 144A	0	5'000	2'000	3'000 USD	101.36%	2'629'483.52	0.22	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	0	3'000	0	3'000 USD	77.97%	2'022'697.59	0.17	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAZ72	4.8750 % MA 4 7/8 05/09/34	0	6'225	0	6'225 USD	99.96%	5'380'550.57	0.44	a)
US58933YAX31	3.4000 % MRK 3.4 03/07/29	3'000	0	0	3'000 USD	95.58%	2'479'544.54	0.20	a)
US58989V2H68	5.2500 % MET 5 1/4 04/12/29 144A	0	4'000	0	4'000 USD	101.83%	3'522'199.80	0.29	a)
US59156RBD98	4.1250 % MET 4 1/8 08/13/42	1'000	0	0	1'000 USD	85.21%	736'836.81	0.06	a)
US59217GCT40	3.6000 % MET 3.6 01/11/24 144A	0	4'965	4'965	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GFP90	5.1500 % MET 5.15 03/28/33 144A	0	5'000	0	5'000 USD	100.50%	4'344'901.33	0.36	a)
US594918BB90	2.7000 % MSFT 2.7 02/12/25	0	1'500	0	1'500 USD	99.44%	1'289'721.67	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	3'000	1'000	0	4'000 USD	69.01%	2'386'779.53	0.20	a)
US61690U8E33	4.9680 % MS 4.968 07/14/28 BKNT	0	1'250	0	1'250 USD	100.49%	1'086'182.10	0.09	a)
US61690U8G80	4.4470 % MS 4.447 10/15/27	0	6'300	0	6'300 USD	99.49%	5'419'609.28	0.45	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	5'000	5'000	0	10'000 USD	95.80%	8'284'171.88	0.68	a)
US61747YFU47	4.6540 % MS 4.654 10/18/30	0	4'410	0	4'410 USD	98.68%	3'762'800.42	0.31	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	0	8'000	0	8'000 USD	99.90%	6'910'336.52	0.57	a)
US64952WFFJ71	3.9000 % NYLIFE 3.9 10/01/27 144A	0	8'100	0	8'100 USD	98.36%	6'889'343.33	0.57	a)
US66815L2R98	5.0700 % NWMLIC 5.07 03/25/27 144A	0	4'700	4'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US66989HAG39	3.4000 % NOVNVX 3.4 05/06/24	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US66989HAH12	4.4000 % NOVNVX 4.4 05/06/44	2'000	0	0	2'000 USD	90.32%	1'562'011.37	0.13	a)
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XBN03	2.1250 % PLD 2 1/8 04/15/27	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LBE92	4.6000 % DGX 4.6 12/15/27	0	550	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109AZ71	0.7500 % O 0 3/4 03/15/26	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109BL76	2.8500 % O 2.85 12/15/32	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	6'400	1'400	5'000 USD	100.60%	4'349'397.77	0.36	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	0	3'000	0	3'000 USD	97.91%	2'539'753.61	0.21	a)
US87264ACA16	2.0500 % TMUS 2.05 02/15/28	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACT07	3.4000 % TMUS 3.4 10/15/52	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADC62	5.7500 % TMUS 5 3/4 01/15/34	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	0	6'050	0	6'050 USD	99.88%	5'225'104.96	0.43	a)
US87264ADM45	4.7000 % TMUS 4.7 01/15/35	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US882508CC69	5.0000 % TXN 5 03/14/53	0	3'000	0	3'000 USD	95.67%	2'481'645.77	0.20	a)
US883556CL42	2.0000 % TMO 2 10/15/31	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FW39	2.9500 % UNP 2.95 03/10/52	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FX12	2.8000 % UNP 2.8 02/14/32	5'000	3'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFL13	5.6250 % UNH 5 5/8 07/15/54	0	4'260	0	4'260 USD	101.82%	3'750'553.41	0.31	a)
US91324PFM95	5.7500 % UNH 5 3/4 07/15/64	0	720	0	720 USD	101.89%	634'375.74	0.05	a)
US92343VGC28	3.7000 % VZ 3.7 03/22/61	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAE21	4.1500 % V 4.15 12/14/35	2'000	2'000	0	4'000 USD	94.36%	3'263'862.03	0.27	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	4'000	3'000	2'000	5'000 USD	88.40%	3'822'060.47	0.31	a)
US92826CAJ18	3.6500 % V 3.65 09/15/47	0	5'000	0	5'000 USD	79.53%	3'438'263.38	0.28	a)
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU74078CD32	4.0000 % NESNVX 4 09/24/48 REGS	1'000	3'000	0	4'000 USD	83.11%	2'874'608.68	0.24	a)
USU74078CK74	1.1500 % NESNVX 1.15 01/14/27 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	92.95%	3'214'781.66	0.26	a)
USU74078CN14	2.5000 % NESNVX 2 1/2 09/14/41 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BV72	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 REGS	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BW55	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	90.35%	3'906'368.72	0.32	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	2'000	5'000	0	7'000 USD	62.23%	3'766'659.14	0.31	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	1'700	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	300'000	0	0	300'000 JPY	98.78%	1'682'210.32	0.14	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	200'000	0	0	200'000 JPY	99.68%	1'131'748.34	0.09	a)
XS1879223565	2.9000 % T 2.9 12/04/26 GBP	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1892836104	1.1590 % AFL 1.159 10/18/30	0	500'000	0	500'000 JPY	98.55%	2'797'098.92	0.23	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193854473	0.5890 % PLD 0.589 06/24/27	0	100'000	0	100'000 JPY	97.79%	555'133.89	0.05	a)
XS2193854804	0.8500 % PLD 0.85 06/24/30	0	400'000	0	400'000 JPY	95.19%	2'161'543.50	0.18	a)
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	1'000	0	2'000 GBP	87.67%	1'949'301.98	0.16	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2583742668	4.0000 % IBM 4 02/06/43	2'500	0	0	2'500 EUR	102.11%	2'396'369.26	0.20	a)
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	3'000	2'000	0	5'000 EUR	101.70%	4'773'728.65	0.39	a)
XS2872909770	3.2780 % AZN 3.278 08/05/33 EMTN	0	3'400	0	3'400 EUR	100.61%	3'211'249.33	0.26	a)
XS2892944732	3.3750 % SYK 3 3/8 09/11/32	0	2'250	2'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2892966032	4.6250 % MASSMU 4 5/8 10/05/29 EMTN	0	3'175	0	3'175 GBP	98.65%	3'482'072.74	0.29	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52894931588	4.0610 % NGGLN 4.061 09/03/36 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	100.94%	2'842'805.33	0.23	a)
X52909746310	3.2500 % CMCSA 3 1/4 09/26/32	0	3'600	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52931344217	3.6250 % CARR 3 5/8 01/15/37 REGS	0	4'000	0	4'000 EUR	98.74%	3'707'796.34	0.30	a)
US							224'205'191.71	18.41	
AU3CB0243194	4.5000 % CAF 4 1/2 09/14/27 MTN	620	0	0	620 AUD	97.57%	342'607.57	0.03	a)
CA298713AK48	4.5500 % EUROF 4.55 03/30/27 MPLE	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	14'000	7'000	11'000	10'000 EUR	87.64%	8'227'093.23	0.68	a)
EU000A3K4EA2	0.0000 % EUB 0 01/12/24 6M	7'400	1'000	8'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EV8	0.0000 % EUB 0 10/04/24 6M	0	13'500	13'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	6'500	9'900	1'400	15'000 EUR	64.31%	9'055'735.51	0.74	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3L28B4	0.0000 % EUB 0 03/07/25 6M	0	15'000	0	15'000 EUR	99.00%	13'940'847.88	1.14	a)
JP500113AL71	0.7700 % CAF 0.77 07/30/25 14	0	200'000	0	200'000 JPY	99.90%	1'134'189.31	0.09	a)
JP500113AM39	0.2500 % CAF 0 1/4 03/19/24 18	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US045167FG35	0.6250 % ASIA 0 5/8 10/08/24 GMTN	4'000	4'500	8'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167FS72	4.1250 % ASIA 4 1/8 09/27/24 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167GB39	4.1250 % ASIA 4 1/8 01/12/34 GMTN	0	19'000	1'000	18'000 USD	98.30%	15'299'846.15	1.26	a)
US15238RAJ14	5.0000 % CABEI 5 01/25/27 REGS	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	1'800	2'200	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CF16	2.2500 % CAF 2 1/4 02/08/27	5'000	0	0	5'000 USD	95.04%	4'109'097.64	0.34	a)
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	6'000	0	500	5'500 USD	99.97%	4'754'613.48	0.39	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	5'050	5'000	5'000	5'050 USD	103.35%	4'513'107.96	0.37	a)
US222213AS92	2.5000 % COE 2 1/2 02/27/24	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29874QAY08	1.6250 % EBRD 1 5/8 09/27/24	0	3'290	3'290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785DV50	4.8750 % EIB 4 7/8 02/15/36	0	2'000	0	2'000 USD	103.94%	1'797'572.95	0.15	a)
US298785JL15	1.2500 % EIB 1 1/4 02/14/31	0	1'000	0	1'000 USD	83.50%	721'998.56	0.06	a)
US298785JM97	0.3750 % EIB 0 3/8 07/24/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	2'283	5'000	0	7'283 USD	81.49%	5'131'922.47	0.42	a)
US4581X0CM87	2.1250 % IADB 2 1/8 01/15/25	1'250	1'500	1'250	1'500 USD	99.48%	1'290'253.46	0.11	a)
US4581X0DP00	0.2500 % IADB 0 1/4 11/15/23	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459056HV23	1.5000 % IBRD 1 1/2 08/28/24 GDIF	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	5'000	0	0	5'000 USD	83.91%	3'627'719.15	0.30	a)
US65562QBL86	2.2500 % NIB 2 1/4 05/21/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65562QBT13	2.6250 % NIB 2 5/8 04/04/25	0	6'500	0	6'500 USD	99.18%	5'574'573.90	0.46	a)
X50241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	300'000	200'000	0	500'000 JPY	101.89%	2'892'041.39	0.24	a)
X50282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	0	700'000	0	700'000 JPY	103.83%	4'125'748.58	0.34	a)
X50307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	0	300'000	0	300'000 JPY	104.73%	1'783'624.21	0.15	a)
X51588672144	6.5000 % EIB 6 1/2 07/07/27 EMTN	0	20'000	20'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
X51622379698	3.0000 % EIB 3 05/24/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
X51649504096	7.0000 % IFC 7 07/20/27 GMTN	0	50'000	20'000	30'000 MXN	93.62%	1'212'077.65	0.10	a)
X51753775730	7.7500 % IFC 7 3/4 01/18/30 GMTN	0	100'000	0	100'000 MXN	93.27%	4'025'110.61	0.33	a)
X51958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	100'000	0	100'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X51963719585	3.0000 % EIB 3 11/25/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 PLN	87.79%	568'201.23	0.05	a)
X51998795535	2.8750 % EIB 2 7/8 11/15/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 PLN	87.83%	568'453.64	0.05	a)
X52055781962	0.0500 % EIB 0.05 10/13/34 EARN	0	4'000	0	4'000 EUR	76.19%	2'860'998.47	0.23	a)
X52166209176	0.0000 % NIB 0 04/30/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52191236715	4.2500 % EIB 4 1/4 06/19/24 EMTN	7'500	0	7'500	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
X52288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	40'000	0	0	40'000 CNY	99.98%	4'851'302.07	0.40	a)
X52296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	9'000	0	9'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52337107259	0.8750 % IDAWBG 0 7/8 04/28/26 REGS	3'000	0	2'000	1'000 USD	95.01%	821'534.18	0.07	a)
X52388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	100'000	26'500	0	126'500 CNY	100.88%	15'480'971.36	1.27	a)
X52437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	0	50'000	0	50'000 CNY	100.16%	6'075'531.00	0.50	a)
X52472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	25'000	0	0	25'000 CNY	102.85%	3'119'227.10	0.26	a)
X52473766314	3.2500 % IBRD 3 1/4 04/28/25 EMTN	50'000	0	50'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	101.03%	3'676'944.87	0.30	a)
X52574358227	2.7000 % ASIA 2.7 01/17/26 EMTN	0	74'000	0	74'000 CNY	100.74%	9'043'135.20	0.74	a)
X52577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	101.30%	1'228'948.00	0.10	a)
X52707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	75'000	45'000	0	120'000 CNY	100.55%	14'637'612.10	1.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52763029571	3.6250 % CAF 3 5/8 02/13/30	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52868924189	2.7500 % IBRD 2 3/4 07/26/34 EMTN	0	50'000	0	50'000 CNY	100.50%	6'096'032.88	0.50	a)
XS							162'588'673.76	13.35	

Derivative Finanzinstrumente

-3'072'627.02 -0.25

Futures

0.00 0.00

12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	-30	30	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	-75	75	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	-100	100	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	155	155	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	125	125	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	125	125	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	55	55	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BOBL FUTURE SEP24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUXL 30Y BND SEP24	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	US 10YR NOTE (CBT)SEP24	0	450	450	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	LONG GILT FUTURE SEP24	0	55	55	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/24	EURO-BUND FUTURE DEC24	0	75	150	-75 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	EURO-BOBL FUTURE DEC24	0	100	25	75 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	EURO-BUXL 30Y BND DEC24	0	0	60	-60 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	US 10YR NOTE (CBT)DEC24	0	250	450	-200 USD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR Verfall 08.07.2024	1'500'000	1'458'870	EUR/CHF	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 29.08.2024	451'309	700'000	CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 29.08.2024	3'253'911	3'675'000	CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 29.08.2024	286'099	250'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 29.08.2024	133'317	225'000	CHF/AUD	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 29.08.2024	2'075'969	2'150'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 29.08.2024	536'826	95'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 29.08.2024	24'922	300'000	CHF/SEK	0.00	0.00	
NZD/CHF Verfall 29.08.2024	26'642	50'000	CHF/NZD	0.00	0.00	
CZK/CHF Verfall 29.08.2024	13'368	350'000	CHF/CZK	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 29.08.2024	55'449	1'125'000	CHF/MXN	0.00	0.00	
CNY/CHF Verfall 29.08.2024	788'830	6'475'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 29.08.2024	12'944	100'000	CHF/DKK	0.00	0.00	
THB/CHF Verfall 29.08.2024	11'588	475'000	CHF/THB	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 29.08.2024	6'068	25'000	CHF/ILS	0.00	0.00	
CHF/CNY Verfall 29.08.2024	16'410'526	2'000'000	CNY/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF Verfall 30.08.2024	190'476	300'000'000	CHF/KRW	0.00	0.00	
CHF/KRW Verfall 30.08.2024	300'000'000	190'749	KRW/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF Verfall 30.09.2024	190'379	300'000'000	CHF/KRW	0.00	0.00	
CHF/KRW Verfall 30.09.2024	300'000'000	190'235	KRW/CHF	0.00	0.00	
EUR/CNY Verfall 07.11.2024	33'299'802	4'300'000	CNY/EUR	3'882.71	0.00	b)

Devisentermingeschäfte

3'882.71 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

NZD/CHF Verfall 16.11.2023	92'981	175'000	CHF/NZD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 16.11.2023	74'610	925'000	CHF/SEK	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 16.11.2023	390'830	675'000	CHF/AUD	0.00	0.00
NOK/CHF Verfall 16.11.2023	18'727	225'000	CHF/NOK	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 16.11.2023	10'607'765	11'925'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 16.11.2023	854'864	775'000	CHF/GBP	0.00	0.00
THB/CHF Verfall 16.11.2023	43'903	1'775'000	CHF/THB	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 16.11.2023	647'206	975'000	CHF/CAD	0.00	0.00
MXN/CHF Verfall 16.11.2023	89'181	1'725'000	CHF/MXN	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 16.11.2023	120'866'248	135'875'000	CHF/USD	0.00	0.00
THB/CHF Verfall 16.11.2023	505'229	20'425'000	CHF/THB	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 16.11.2023	9'706'840	8'800'000	CHF/GBP	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		30'228'299	4'975'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		5'065'459	5'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		857'002	10'625'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		222'667	2'675'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		372'090	2'900'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		41'154	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		1'027'571	19'875'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		4'473'069	7'725'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		622'042	15'950'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		483'560	2'350'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		2'016'762	16'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		53'622	1'375'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		1'129'121	2'125'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		311'145	475'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		286'781	1'225'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		2'643'077	435'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		58'133'311	60'825'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		23'223'320	190'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		7'484'356	11'275'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		25'000	23'900		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'200'000	269'355		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		70'000'000	425'575		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		850'000	812'603		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		175'000	116'242		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		2'175'000	1'935'693		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		200'000	177'995		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		5'500'000	33'438		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		75'000	43'950		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		2'525'000	2'302'303		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		12'000'000	73'792		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.11.2023		100'000	5'135		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		650'000	627'485		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 16.11.2023		125'000	4'940		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 16.11.2023		125'000	3'116		THB/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		196'894	1'575'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.11.2023		50'000	4'170		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		125'000	84'541		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		125'000	138'403		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		500'000	480'151		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'000'000	911'433		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		125'000	72'376		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		45'000'000	277'457		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		242'443	40'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		60'611	10'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		82'699	125'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		16'540	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		811'615	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		95'484	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		135'501	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		1'151'757	1'275'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		71'154	575'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		110'378	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		175'000	156'768		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		75'000	49'123		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		575'000	543'323		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'000'000	244'838		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		25'000	23'623		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		40'000'000	240'200		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		125'000	136'087		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		150'000	18'363		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'825'000	1'635'120		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		6'000'000	36'039		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		10'000	6'542		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		20'000	11'499		AUD/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		2'030	25'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		5'388	25'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		14'220	175'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		215'439	325'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		3'631'064	4'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		37'136	300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		48'010	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'053	300'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		27'528	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		333'131	13'225'000		CHF/THB	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		1'254	25'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		28'968	1'150'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		1'195'683	9'650'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		193'151	1'500'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		114'563	175'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		12'692	325'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		2'738'893	2'850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		827'024	750'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		25'000	14'392	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		660'303	110'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		165'272	150'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		937'343	975'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		131'297	200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		301'177	50'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		5'684	25'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		2'534'283	2'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		4'904	125'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		234'827	1'900'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		14'533	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		6'440	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		8'988	175'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		8'133	100'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		5'396	25'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		13'315	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		2'025	25'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		5'663	225'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'275'000	281'524	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		300'000	37'124	CNY/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		2'668'446	4'000'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		233'489	350'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		466'667	700'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		90'000'000	60'932	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		46'962	70'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		10'000'000	6'721	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		57'088	85'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		4'695'000'000	3'186'231	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		410'000'000	278'244	KRW/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		29'966'801	5'050'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		2'063'400	16'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		10'735'778	9'725'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		571'568	4'425'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		60'729'808	63'075'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		7'396'608	11'450'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		1'137'918	2'150'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		223'231	2'750'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		1'019'146	20'225'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		24'050'555	196'400'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		638'359	16'300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		4'384'177	7'625'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		77'243	925'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		373'772	650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		121'862'834	137'575'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		525'636	800'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		829'362	33'600'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		70'965	2'875'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		910'747	825'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		5'199'493	5'400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		92'621	175'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		2'551'887	430'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		86'923	1'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		522'182	2'400'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		53'849	1'375'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		629'910	975'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		43'515	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		10'452'346	11'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		18'267	225'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		904'061	10'825'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		292'594	1'250'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		4'000'000	23'712	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		95'000'000	563'161	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'116'805	2'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		575'507	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		67'149	70'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		229'142	260'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		6'500'000	38'560		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		200'000	175'261		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		65'318	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		966	25'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		332'435	6'725'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		10'608	275'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		247'006	225'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		847'768	900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		5'987	75'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		27'445	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		238'207	40'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		16'645	200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		100'069	175'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		152'263	175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		56'574	9'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		9'479	75'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		16'050	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		783'067	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		16'262	25'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		256'796	400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		28'424	575'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		70'647	75'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		13'364	25'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'616'392	3'025'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		439'482	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		237'854	275'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		27'468	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'133'942	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		94'495	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		214'711	35'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		24'538	4'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		39'506	325'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		9'117	75'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		87'125	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		14'521	25'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		10'548	125'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		2'110	25'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		9'613	250'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		1'923	50'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		22'523	450'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		2'503	50'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		177'895	275'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		16'172	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		4'128	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		6'339	50'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		5'452	25'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		50'000	1'244		THB/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		66'834	11'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 18.01.2024		25'000	5'907		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 18.01.2024		25'000	5'444		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		25'000	27'355		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 18.01.2024		50'000	6'345		DKK/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		32'452	650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		175'000	14'854		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		185'011	1'525'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		625'000	24'055		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 18.01.2024		50'000	4'160		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		225'000	145'383		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		23'640	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		18'198	150'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 18.01.2024		25'000	13'424		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		275'000	10'584		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		175'000	151'417		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		374'444	7'500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		729'101	120'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		150'000	86'962		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		775'000	19'200		THB/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		118'202	125'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		25'000	619		THB/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		3'576'184	4'175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		500'000	12'320		THB/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'365'462	1'450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		784'839	130'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		1'197'309	9'975'000		CHF/CNY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		625'000	582'700		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		71'112	600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		25'000	23'308		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		63'875	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		3'211'143	4'750'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		277'172	410'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		324'934	490'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		26'525	40'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		59'783	90'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		5'978	9'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		10'000'000	6'689		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		140'000'000	93'645		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		5'190'000'000	3'347'221		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		449'000'000	289'577		KRW/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		578'264	4'625'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		125'039'655	146'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		91'970	175'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		773'207	33'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		4'464'472	7'900'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		42'349	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		24'371'630	205'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		18'410	225'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		524'044	2'475'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		11'092'224	12'975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		11'147'484	10'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		395'586	700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		78'113	950'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		904'354	11'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		68'534	2'925'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		1'169'260	2'225'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		54'438	1'450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		2'699'616	460'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		542'543	850'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		973'962	900'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		152'863	3'100'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		7'552'228	11'900'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		233'170	2'850'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		666'342	1'050'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		30'344'436	5'170'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		1'765'327	35'800'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		2'160'390	18'175'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		630'731	16'800'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'404'544	5'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		61'040'629	65'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		283'844	1'250'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		2'469	50'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		5'000'000	29'356		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		940	25'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		25'000	23'329		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 14.03.2024		75'000	47'962		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		125'000	14'875		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024		100'000	12'520		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		25'000	13'156		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		50'000	4'099		NOK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		21'384	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		50'000	10'607		PLN/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		2'058	25'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		25'000	21'581		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		225'000	143'778		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		25'000	15'975		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		1'500'000	74'768		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		450'000	388'825		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		175'000	151'210		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		325'000	26'681		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		40'000'000	235'204		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		3'000'000	17'640		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		125'000	6'231		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		1'175'000	1'015'779		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		525'000	494'807		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		85'929	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		75'000'000	441'759		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		837'805	975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		128'708	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		70'063	75'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		385'126	680'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		633'369	990'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		2'014'034	16'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		48'841	390'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		54'389	1'450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'924'677	6'350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		217'001	4'380'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		21'152	90'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		957'542	880'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		2'627'038	448'630'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		44'318	540'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		89'305	170'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		42'704	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		81'616	990'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		83'509	130'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		9'833'549	11'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		74'626	3'070'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		42'905	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		32'838	5'575'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		93'029	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		86'045	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'376'016	1'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 14.03.2024		250'000	142'961		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		500'000	326'353		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		3'175'000	3'011'907		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 14.03.2024		475'000	529'277		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		194'925'000	1'149'506		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		75'000	40'216		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		8'150'000	7'204'771		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		7'825'000	958'242		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024		175'000	22'279		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 14.03.2024		25'000	6'030		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		375'000	14'018		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		1'050'000	53'746		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		100'000	8'304		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		75'000	16'379		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		500'000	41'866		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 14.03.2024		25'000	16'385		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		1'275'000	31'331		THB/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		703'748	120'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		138'920	125'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		27'784	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		16'306	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		12'202	325'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		3'195	25'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		10'654	125'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		13'615	25'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		57'650	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		2'458	100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		94'850	775'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		2'131	25'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		2'816	75'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		544'622	4'450'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		22'010	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		58'646	10'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		2'333'243	2'450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		25'632	500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		2'531'098	2'875'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		13'615	25'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		12'816	250'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		119'043	125'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		14'413	25'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		2'094	25'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		10'446	425'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		114'144	175'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		5'502	25'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		35'152	275'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		33'056	150'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		667'255	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		12'235	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		16'199	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		761'346	1'175'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		32'648	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		31'913	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		47'637	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		10'897'182	12'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'787'835	6'075'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		20'000	10'702	NZD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		66'881	125'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		7'500'000	43'791	JPY/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		50'969	600'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		271'185	475'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		75'000	9'140	CNY/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		47'526	1'950'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		1'861'305	15'275'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		150'000	12'743	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		25'000	1'283	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		110'322	2'150'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		1'751'610	300'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		12'461	150'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		43'940	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		25'000	610	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		1'900'000	46'776	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 14.03.2024		600'000	671'380	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		9'925'000	375'023	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		1'175'000	44'398	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		300'000'000	1'769'514	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		500'000	42'877	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		175'000	14'718	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		12'025'000	1'475'468	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		125'000	27'740	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		8'475'000	7'494'129	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		125'000	67'519	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		2'050'000	106'439	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		3'900'000	3'737'721	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 14.03.2024		475'000	274'479	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		675'000	440'483	CAD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		3'342'508	5'200'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		289'256	450'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		11'591	18'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		325'930	503'550'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		184'700'000	122'724	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		6'579	10'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		26'316	40'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		210'356	325'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		5'500'000	3'560	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		300'000'000	198'983	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		5'883'850'000	3'940'124	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		172'500'000	115'515	KRW/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		143'826'627	164'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		3'956'325	4'525'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		72'585'295	75'900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		1'984'381	2'075'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		34'134'355	5'730'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		923'355	155'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		13'079'781	11'700'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		335'379	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		8'860'169	13'675'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		242'966	375'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		27'706'329	227'075'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		762'588	6'250'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		261'677	3'150'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		6'230	75'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		1'055'579	12'350'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		27'778	325'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		651'092	5'075'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		13'205	350'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		493'284	13'075'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		606'511	2'725'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		16'693	75'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.04.2024		608'090	925'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.04.2024		328'477	1'375'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		2'102'053	40'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		56'777	1'100'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		910'888	37'150'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		24'519	1'000'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		2'175'000	2'086'799	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		25'000	23'986	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		2'125'000	1'869'862		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		55'000'000	328'521		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		2'525'000	309'494		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		225'000	146'813		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		650'000	33'955		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		200'000	224'851		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		2'350'000	2'078'967		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		22'112	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		250'000	21'240		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		75'000	6'241		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.04.2024		50'000	11'135		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		325'000	16'971		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		30'000'000	176'788		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		1'000'000	962'503		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		75'000	9'685		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		7'875'000	968'625		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		75'000	84'457		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		100'000	12'300		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		325'000	12'366		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		175'000	114'236		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		575'000	14'131		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		375'000	337'459		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		22'497	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		75'000	73'194		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		24'398	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		35'000'000	208'770		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		28'417	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		32'807	5'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		25'000	2'129		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		25'000	3'272		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		75'000	2'889		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		125'000	6'721		MXN/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		1'344	25'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		1'725'000	214'505		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		200'000	4'965		THB/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		621	25'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		2'103	25'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		3'075'000	165'677		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 25.04.2024		125'000	30'689		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		1'025'000	39'332		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		225'000	18'647		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		1'650'000	9'828		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		950'000	79'905		SEK/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		2'693	50'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		12'383	100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 25.04.2024		75'000	49'990		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		680'000'000	4'050'413		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		2'875'000	70'901		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		17'400'000	15'633'378		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		375'000	48'843		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.04.2024		200'000	45'059		PLN/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		1'232	50'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		20'575'000	2'547'905		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		8'500'000	8'255'115		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		1'100'000	1'248'775		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		975'000	647'622		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		25'000	22'598		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'050'000	949'106		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		125'000	83'608		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		6'235	50'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		25'000	24'477		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		50'000	1'930		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		25'000	2'105		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		1'000'000	5'972		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		125'000	142'597		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		50'000	4'247		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		225'000	12'228		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		450'000	440'577		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		35'000'000	209'032		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		91'200	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		40'000'000	236'280		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'700'000	1'550'407		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		200'000	7'678		CZK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		23'037	3'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		175'000	198'570	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		625'000	33'343	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		16'488	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		28'229	225'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		48'485	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		5'197'041	9'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		129'926	225'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		1'316'209	2'450'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		26'861	50'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		150'000	86'973	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		25'000	14'462	AUD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		14'712	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		25'000	13'519	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		175'000	94'051	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		675'000	395'918	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		25'000	14'800	AUD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		3'939'518	5'900'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		113'512	170'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		8'000'000	5'342	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		160'000'000	107'962	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		23'396	35'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		2'005	3'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		450'000'000	302'013	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		3'356	5'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		20'000'000	13'427	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		170'000'000	112'564	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		5'305'000'000	3'512'663	KRW/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		126'639'787	139'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		4'733'561	8'050'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		11'503'672	10'200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		28'535'451	4'845'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		8'099'080	12'200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		62'521'881	64'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		24'583'257	196'600'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		445'497	11'600'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		301'294	1'250'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		599'293	4'600'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		1'928'411	36'350'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		938'963	11'200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		567'088	850'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		1'210'700	2'250'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		831'870	33'950'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		60'292	725'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		626'630	550'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		27'083	700'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		54'606	2'225'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		608'616	11'475'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		2'635'794	21'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		24'174	100'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		515'615	775'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		1'890'918	325'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		12'007'110	13'225'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		5'208'626	5'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		983'301	1'650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		39'174	300'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		33'411	50'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		40'644	75'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		60'866	1'150'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		27'150	50'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		16'728	25'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		16'302	125'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		339'689	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		20'880	850'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		4'217'953	4'675'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		2'990'315	3'075'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		25'068	300'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		6'071	25'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 30.05.2024		1'475'000	973'521	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		12'612	325'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		164'205	275'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		672'046	5'350'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		681'081	115'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		551'003	2'450'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		39'416	175'000	CHF/PLN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		16'824	75'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		3'596'766	5'450'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		125'000'000	82'719	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		211'508	320'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		99'871	150'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		5'795'000'000	3'893'320	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.07.2024		27'897'288	222'950'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		72'131'571	73'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 11.07.2024		1'324'065	2'375'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 11.07.2024		339'140	1'375'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.07.2024		2'633'753	48'975'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		917'665	37'025'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		145'820'598	161'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 11.07.2024		622'806	925'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.07.2024		7'645'212	11'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 11.07.2024		504'066	12'625'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.07.2024		30'717'213	5'285'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 11.07.2024		664'953	5'025'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.07.2024		1'052'120	12'225'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.07.2024		12'791'535	11'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.07.2024		6'028'202	9'975'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		1'139'091	1'175'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		1'601'827	1'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.07.2024		1'241'294	10'150'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.07.2024		95'007	100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.07.2024		146'783	250'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.07.2024		19'133	400'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		7'269	300'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.07.2024		21'054	250'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.07.2024		322'839	500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 11.07.2024		6'369	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.07.2024		337'603	300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.07.2024		1'132'178	200'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 11.07.2024		7'680	200'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2024		2'175'700	2'450'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.07.2024		5'485'000'000	30'508'667	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 11.07.2024		5'075'000	660'461	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 11.07.2024		49'375'000	2'468'627	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 11.07.2024		1'375'000	336'105	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 11.07.2024		233'100'000	28'689'948	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 11.07.2024		925'000	614'598	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 11.07.2024		12'825'000	492'762	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.07.2024		74'375'000	72'206'969	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.07.2024		165'250'000	148'330'053	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 11.07.2024		12'475'000	1'060'126	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 11.07.2024		2'375'000	1'305'205	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 11.07.2024		11'350'000	13'038'767	GBP/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.07.2024		38'245'546	38'245'546	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 11.07.2024		10'225'000	6'179'070	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 11.07.2024		12'000'000	7'897'680	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 11.07.2024		37'325'000	920'546	THB/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 11.07.2024		3'882'068	5'795'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 11.07.2024		101'911	160'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 11.07.2024		5'955'000'000	3'871'013	KRW/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 29.08.2024		30'862'177	5'540'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 29.08.2024		674'664	5'200'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 29.08.2024		2'528'652	51'275'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 29.08.2024		340'834	1'400'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 29.08.2024		29'517'046	240'500'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 29.08.2024		628'936	950'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 29.08.2024		502'863	13'150'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		74'297'472	76'800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		152'067'516	170'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 29.08.2024		1'079'798	12'750'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 29.08.2024		1'338'614	2'450'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		13'310'766	11'650'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 29.08.2024		6'211'448	10'325'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 29.08.2024		7'910'163	12'075'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 29.08.2024		932'538	37'925'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		6'790'945	7'750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		3'954'718	4'150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 29.08.2024		36'550	450'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 29.08.2024		350'000	201'224	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 29.08.2024		444'536	700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		620'952	550'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 29.08.2024		1'603'722	280'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 29.08.2024		19'161	150'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 29.08.2024		1'239'422	10'200'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 29.08.2024		78'333	1'650'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 29.08.2024		22'513	600'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 29.08.2024		16'353	25'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 29.08.2024		11'972	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 29.08.2024		38'804	75'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 29.08.2024		26'714	1'100'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 29.08.2024		175'000	100'929	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		1'350'000	1'290'200	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 29.08.2024		200'000	226'161	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 29.08.2024		25'000	12'948	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 29.08.2024		90'000'000	518'333	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 29.08.2024		800'000	37'924	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 29.08.2024		200'000	16'309	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 29.08.2024		175'000	111'323	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 29.08.2024		275'000	10'369	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 29.08.2024		75'000	9'615	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.08.2024		3'100'000	2'727'324	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.08.2024		4'925'000	598'658	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 29.08.2024		725'000	17'816	THB/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		3'226'184	3'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 29.08.2024		777'601	135'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 29.08.2024		816'127	6'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		1'462'635	1'575'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		513'751	475'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		3'980'867	4'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.08.2024		252'475'000	29'842'545	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 29.08.2024		12'600'000	7'891'884	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 29.08.2024		2'500'000	1'313'050	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.08.2024		183'400'000	154'553'014	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 29.08.2024		1'450'000	331'847	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 29.08.2024		9'800'000	5'599'720	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 29.08.2024		13'000'000	1'075'880	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		81'175'000	76'389'734	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 29.08.2024		52'125'000	2'232'415	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 29.08.2024		12'475'000	13'912'619	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 29.08.2024		5'865'000'000	34'263'330	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 29.08.2024		5'275'000	665'389	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 29.08.2024		38'300'000	947'389	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 29.08.2024		13'475'000	506'714	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 29.08.2024		975'000	630'455	SGD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 29.08.2024		3'856'998	5'955'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 29.08.2024		212'699	335'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 29.08.2024		115'000'000	73'178	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 29.08.2024		6'175'000'000	3'926'244	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.09.2024		30'925'612	261'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.09.2024		8'668'684	13'875'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.09.2024		1'361'048	2'600'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.09.2024		160'577'026	191'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 27.09.2024		336'762	1'475'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.09.2024		5'998'019	10'525'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.09.2024		1'131'676	13'700'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.09.2024		80'339'919	85'550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.09.2024		2'391'799	56'300'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.09.2024		15'036'554	13'525'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.09.2024		36'453'987	6'235'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.09.2024		698'839	5'550'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.09.2024		985'768	39'925'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.09.2024		533'913	14'200'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.09.2024		645'456	1'000'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.09.2024		39'704	75'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 27.09.2024		11'569	50'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.09.2024		18'864	150'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.09.2024		1'494'838	12'500'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.09.2024		1'722'995	295'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.09.2024		11'216	300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.09.2024		7'362'010	8'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.09.2024		22'735	275'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.09.2024		16'249	25'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.09.2024		455'621	725'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.09.2024		2'649'398	2'825'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 27.09.2024		779'516	700'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.09.2024		23'101	925'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.09.2024		49'852	1'175'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.09.2024		129'384	225'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.09.2024	6'530'000'000		38'397'053	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.09.2024	14'225'000		16'150'496	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.09.2024	88'375'000		83'819'269	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.09.2024	199'900'000		169'703'106	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 27.09.2024	57'475'000		2'503'749	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 27.09.2024	14'600'000		9'210'118	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 27.09.2024	1'525'000		345'931	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 27.09.2024	2'675'000		1'431'018	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 27.09.2024	5'700'000		724'983	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 27.09.2024	10'750'000		6'262'843	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 27.09.2024	1'025'000		676'490	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 27.09.2024	14'500'000		546'882	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 27.09.2024	13'975'000		1'170'127	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 27.09.2024	274'200'000		33'109'650	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 27.09.2024	40'850'000		1'060'548	THB/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 30.09.2024	3'918'630	6'175'000'000		CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 30.09.2024	336'539	530'000'000		CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 30.09.2024	6'705'000'000		4'259'149	KRW/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024	37'655'744	6'400'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024	15'616'370	13'800'000		CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024	83'331'929	88'050'000		CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024	166'674'533	196'975'000		CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024	2'502'577	57'900'000		CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024	8'933'987	14'200'000		CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024	1'399'695	2'625'000		CHF/NZD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024	720'470	5'675'000		CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024	6'186'979	10'650'000		CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024	658'736	1'000'000		CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024	533'164	14'175'000		CHF/CZK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024	1'159'477	13'875'000		CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024	33'788'657	280'025'000		CHF/CNY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024	1'042'974	40'250'000		CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.10.2024	725'000	685'517		EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.10.2024	250'000	31'511		DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 25.10.2024	25'000	16'422		SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.10.2024	540'000'000	3'183'818		JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.10.2024	625'000	52'138		SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.10.2024	550'000	20'538		CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.10.2024	475'000	276'535		AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.10.2024	1'150'000	716'428		CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 25.10.2024	75'000	40'090		NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.10.2024	1'775'000	46'089		THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.10.2024	16'450'000	13'811'897		USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.10.2024	7'175'000	6'741'178		EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.10.2024	18'425'000	785'738		MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.10.2024	12'650'000	1'524'945		CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.10.2024	1'000'000	1'125'695		GBP/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024	785'334	700'000		CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024	6'312'634	6'750'000		CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024	37'627	300'000		CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024	2'208'014	18'375'000		CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024	27'718	750'000		CHF/CZK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024	12'462'181	14'775'000		CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024	859'903	1'375'000		CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024	305'477	525'000		CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024	16'393	25'000		CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024	2'826'725	480'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024	92'692	2'175'000		CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024	552'187	6'700'000		CHF/SEK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024	55'111	2'125'000		CHF/THB		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024	53'171	100'000		CHF/NZD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024	26'865	725'000		CHF/CZK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024	2'472'472	425'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024	79'445	150'000		CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024	32'840	50'000		CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024	781'574	700'000		CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024	13'799'759	16'200'000		CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024	676'552	1'075'000		CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024	520'432	11'975'000		CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024	3'093'143	25'575'000		CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024		6'809'577	7'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024		90'869	1'100'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024		37'775	300'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024		55'248	2'150'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024		335'146	575'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024		216'775	375'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024		251'170	400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024		2'860'350	23'625'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024		1'443'928	250'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024		83'605	1'900'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024		52'327	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024		59'828	725'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024		18'488	500'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024		25'169	200'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024		3'331'025	3'550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024		502'758	450'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024		32'778	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024		9'995'591	11'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024		44'008	1'725'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.10.2024		2'756'735	22'825'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.10.2024		717'844	1'150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.10.2024		1'466'364	1'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.10.2024		57'443	2'225'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.10.2024		78'696	150'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.10.2024		109'588	2'500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.10.2024		8'172'362	8'700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2024		11'755'749	13'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.10.2024		824'709	1'425'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.10.2024		31'655	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.10.2024		3'581'945	620'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.10.2024		40'918	325'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.10.2024		32'924	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.10.2024		87'206	1'050'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.10.2024		16'450'000	608'551		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.10.2024		6'550'000	820'388		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 25.10.2024		3'050'000	1'588'410		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.10.2024		357'775'000	43'444'618		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.10.2024		13'075'000	7'522'832		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.10.2024		7'635'000'000	43'256'856		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.10.2024		46'700'000	1'208'643		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.10.2024		58'025'000	2'517'699		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.10.2024		236'850'000	205'370'267		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.10.2024		106'400'000	99'409'520		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 25.10.2024		1'150'000	753'446		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.10.2024		17'050'000	10'677'051		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.10.2024		22'825'000	1'865'716		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.10.2024		15'950'000	17'904'513		GBP/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.10.2024		339'347	1'500'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 28.10.2024		50'000	11'357		ILS/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.10.2024		11'245	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.10.2024		16'796	75'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.10.2024		16'912	75'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.10.2024		17'181	75'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 28.10.2024		1'725'000	394'283		ILS/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.10.2024		4'245'980	6'700'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.10.2024		100'000'000	63'631		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.10.2024		270'000'000	174'192		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.10.2024		222'222	350'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.10.2024		251'618	395'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.10.2024		158'990	250'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.10.2024		208'141	330'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.10.2024		7'655'000'000	4'809'577		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 29.11.2024		603'864	16'375'000		CHF/CZK	-1'919.42	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 29.11.2024		818'763	6'550'000		CHF/DKK	-4'343.61	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 29.11.2024		393'133	1'725'000		CHF/ILS	-4'448.97	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 29.11.2024		1'582'590	3'050'000		CHF/NZD	17'439.67	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 29.11.2024		42'934'581	354'050'000		CHF/CNY	29'336.60	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 29.11.2024		7'439'709	12'975'000		CHF/AUD	111'000.08	0.01	b)
	JPY/CHF Verfall 29.11.2024		43'090'784	7'600'000'000		CHF/JPY	-79'883.51	-0.01	b)
	THB/CHF Verfall 29.11.2024		1'202'034	46'625'000		CHF/THB	10'348.28	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 29.11.2024		2'459'841	57'275'000		CHF/MXN	6'462.03	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 29.11.2024		99'130'962	106'350'000		CHF/EUR	-517'851.06	-0.04	b)
	SGD/CHF Verfall 29.11.2024		751'764	1'150'000		CHF/SGD	1'480.92	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 29.11.2024		10'632'266	17'025'000		CHF/CAD	94'370.60	0.01	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 29.11.2024		18'002'988	16'100'000		CHF/GBP	160'050.25	0.01	b)
	SEK/CHF Verfall 29.11.2024		1'857'670	22'775'000		CHF/SEK	20'159.39	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 02.12.2024		202'466'583	234'475'000		CHF/USD	388'972.68	0.03	b)
	KRW/CHF Verfall 02.12.2024		4'799'755	7'655'000'000		CHF/KRW	11'060.96	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							242'234.89	0.02	

Swaps

										-3'318'744.62	-0.27
09/27	IRS FIX LEG 2.41502% P.A. EUR	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00			
09/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-10'000	10'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00			
10/27	IRS FIX LEG 2.95% P.A. EUR	25'000	0	25'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00			
10/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-25'000	25'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00			
01/28	IRS FIX LEG 2.8012% P.A. EUR	15'000	0	15'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00			
01/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EUR006M	-15'000	15'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00			
02/28	IRS FIX LEG 0.4725% P.A. JPY	3'000'000	0	3'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00			
02/28	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-3'000'000	3'000'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00			
07/28	IRS FIX LEG 0.2463% P.A. JPY	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00			
07/28	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'000'000	1'000'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00			
07/28	IRS FIX LEG 2.4355% P.A. CNY	150'000	0	0	150'000 CNY	102.63%	18'674'680.67	1.53	b)		
07/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	-150'000	0	0	-150'000 CNY	100.00	-18'196'932.00	-1.49	b)		
09/28	IRS FIX LEG 0.289% P.A. JPY	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00			
09/28	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-300'000	300'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00			
12/28	IRS FIX LEG 2.396% P.A. CNY	0	100'000	0	100'000 CNY	102.70%	12'458'440.19	1.02	b)		
12/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	0	0	100'000	-100'000 CNY	100.00	-12'131'288.00	-1.00	b)		
12/28	IRS FIX LEG 2.2925% P.A. CNY	0	80'000	0	80'000 CNY	102.28%	9'926'232.40	0.82	b)		
12/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	0	0	80'000	-80'000 CNY	100.00	-9'705'030.40	-0.80	b)		
01/29	IRS FIX LEG 2.335% P.A. EUR	0	28'000	0	28'000 EUR	99.40%	26'126'342.01	2.15	b)		
01/29	IRS FLOATING LEG - EUR - ESTRON	0	0	28'000	-28'000 EUR	100.00	-26'285'242.76	-2.16	b)		
03/29	IRS FIX LEG 0.5% P.A. JPY	0	0	3'809'000	-3'809'000 JPY	99.61%	-21'538'936.55	-1.77	b)		
03/29	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	3'809'000	0	3'809'000 JPY	100.00	21'622'474.12	1.78	b)		
05/30	IRS FIX LEG 3.10609% P.A. USD	15'000	0	0	15'000 USD	95.56%	12'395'107.55	1.02	b)		
05/30	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-15'000	0	0	-15'000 USD	100.00	-12'970'500.00	-1.07	b)		
01/33	IRS FIX LEG 0.79253% P.A. JPY	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	100.12%	5'683'704.23	0.47	b)		
01/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-1'000'000	0	0	-1'000'000 JPY	100.00	-5'676'680.00	-0.47	b)		
02/33	IRS FIX LEG 0.8555% P.A. JPY	1'250'000	0	0	1'250'000 JPY	100.58%	7'137'040.27	0.59	b)		
02/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'250'000	0	0	-1'250'000 JPY	100.00	-7'095'850.00	-0.58	b)		
07/33	IRS FIX LEG 3.55612% P.A. USD	15'000	0	0	15'000 USD	97.76%	12'679'882.14	1.04	b)		
07/33	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-15'000	0	0	-15'000 USD	100.00	-12'970'500.00	-1.07	b)		
09/33	IRS FIX LEG 0.8395% P.A. JPY	800'000	0	0	800'000 JPY	99.75%	4'529'958.27	0.37	b)		
09/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-800'000	0	0	-800'000 JPY	100.00	-4'541'344.00	-0.37	b)		
11/33	IRS FIX LEG 0.12575% P.A. JPY	700'000	0	700'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00			
11/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-700'000	700'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00			
07/42	IRS FIX LEG 2.819% P.A. USD	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00			
07/42	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	-4'000	4'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00			
01/43	IRS FIX LEG 1.3375% P.A. JPY	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.53%	5'649'952.02	0.46	b)		
01/43	IRS FLOATING LEG - JPY OIS TONAR	-1'000'000	0	0	-1'000'000 JPY	100.00	-5'676'680.00	-0.47	b)		
02/43	IRS FIX LEG 1.26% P.A. JPY	1'500'000	0	0	1'500'000 JPY	98.06%	8'350'064.99	0.69	b)		
02/43	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-1'500'000	0	0	-1'500'000 JPY	100.00	-8'515'020.00	-0.70	b)		
03/43	IRS FIX LEG 3.4366% P.A. USD	7'500	0	0	7'500 USD	93.59%	6'069'421.49	0.50	b)		
03/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'500	0	0	-7'500 USD	100.00	-6'485'250.00	-0.53	b)		
09/43	IRS FIX LEG 4.1578% P.A. USD	17'500	0	0	17'500 USD	104.35%	15'791'124.44	1.30	b)		
09/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-17'500	0	0	-17'500 USD	100.00	-15'132'250.00	-1.24	b)		
10/43	IRS FIX LEG 4.618% P.A. USD	-17'500	17'500	0	0 USD	0.00%	0.00	0.00			
10/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	17'500	0	17'500	0 USD	0.00	0.00	0.00			
12/43	IRS FIX LEG 3.4793% P.A. USD	0	10'000	5'000	5'000 USD	93.63%	4'047'907.56	0.33	b)		
12/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	5'000	10'000	-5'000 USD	100.00	-4'323'500.00	-0.36	b)		
01/44	IRS FIX LEG 1.34875% P.A. JPY	0	500'000	0	500'000 JPY	98.83%	2'805'253.98	0.23	b)		
01/44	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	500'000	-500'000 JPY	100.00	-2'838'340.00	-0.23	b)		
03/44	IRS FIX LEG 1.34125% P.A. JPY	0	1'050'000	550'000	500'000 JPY	98.41%	2'793'074.72	0.23	b)		
03/44	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	550'000	1'050'000	-500'000 JPY	100.00	-2'838'340.00	-0.23	b)		
09/44	IRS FIX LEG 1.3912% P.A. JPY	0	1'200'000	0	1'200'000 JPY	98.31%	6'696'599.76	0.55	b)		
09/44	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'200'000	-1'200'000 JPY	100.00	-6'812'016.00	-0.56	b)		

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
10/48	IRS FIX LEG 0.911% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	85.40%	1'212'038.47	0.10	b)
10/48	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'419'170.00	-0.12	b)
12/48	IRS FIX LEG 1.405% P.A. JPY	0	1'200'000	0	1'200'000 JPY	96.48%	6'572'225.43	0.54	b)
12/48	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'200'000	-1'200'000 JPY	100.00	-6'812'016.00	-0.56	b)
02/50	IRS FIX LEG 0.2445% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	69.99%	993'231.12	0.08	b)
02/50	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'419'170.00	-0.12	b)
07/51	IRS FIX LEG 0.36451% P.A. JPY	350'000	0	0	350'000 JPY	70.69%	1'404'558.16	0.12	b)
07/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONAR	-350'000	0	0	-350'000 JPY	100.00	-1'986'838.00	-0.16	b)
11/51	IRS FIX LEG 0.47% P.A. JPY	200'000	0	0	200'000 JPY	73.05%	829'390.89	0.07	b)
11/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-200'000	0	0	-200'000 JPY	100.00	-1'135'336.00	-0.09	b)
02/53	IRS FIX LEG 1.31% P.A. JPY	500'000	0	0	500'000 JPY	91.58%	2'599'310.47	0.21	b)
02/53	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-500'000	0	0	-500'000 JPY	100.00	-2'838'340.00	-0.23	b)
04/53	IRS FIX LEG 2.967% P.A. USD	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
04/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-4'000	4'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/53	IRS FIX LEG 3.21718% P.A. USD	7'500	0	0	7'500 USD	90.91%	5'895'468.44	0.48	b)
06/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'500	0	0	-7'500 USD	100.00	-6'485'250.00	-0.53	b)
08/53	IRS FIX LEG 3.56724% P.A. USD	16'000	0	0	16'000 USD	97.55%	13'495'642.47	1.11	b)
08/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-16'000	0	0	-16'000 USD	100.00	-13'835'200.00	-1.14	b)
09/53	IRS FIX LEG 3.9383% P.A. USD	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
09/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'000	7'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/53	IRS FIX LEG 4.29579% P.A. USD	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
11/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-5'500	5'500	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/54	IRS FIX LEG 1.59675% P.A. JPY	0	500'000	0	500'000 JPY	96.73%	2'745'488.83	0.23	b)
10/54	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	500'000	-500'000 JPY	100.00	-2'838'340.00	-0.23	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	93'171'473.24	7.65
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'118'292'349.46	91.85
Derivative Finanzinstrumente	-3'072'627.02	-0.25
Sonstige Vermögenswerte	9'177'426.28	0.75
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'217'568'621.96	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-18'375.38	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'217'550'246.58	

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);	1'118'292'349.46	91.85
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-3'072'627.05	-0.25
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts

OTC COLLATERAL IV-BFNINT JPY ZKB	556'619'000 JPY	3'159'747.94
----------------------------------	-----------------	--------------

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
CNY	1 = CHF	0.12131288
CZK	100 = CHF	3.70883500
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
HUF	100 = CHF	0.22992000
ILS	1 = CHF	0.23114758
JPY	100 = CHF	0.56766800
KRW	1 = CHF	0.00062659
MXN	1 = CHF	0.04315732
NOK	100 = CHF	7.83924400
NZD	1 = CHF	0.51462621
PLN	1 = CHF	0.21573275
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
THB	100 = CHF	2.56245400
USD	1 = CHF	0.86470000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	208'770'778.19	17.147
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	494'937'436.78	40.650

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
GTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
Swiss Red Cross	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.500	0.750	0.400	0.100	2.000
GT CHF	0.400	0.650	0.300	0.100	2.000
GTH1 CHF	0.400	0.700	0.300	0.100	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000
Swiss Red Cross	0.700	0.900	0.500	0.200	2.000

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.

Benchmark

Bloomberg Global Aggregate TR Index Unhedged CHF

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
Swiss Red Cross	Ja	CHF	0.67500	0.23625	0.43875

CHF 0.675 pro Anteil gehen als Spende an das Schweizerische Rote Kreuz.

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	1.558	0.545	1.013
GT CHF	Ja	CHF	1.771	0.619	1.152
GTH1 CHF	Ja	CHF	1.695	0.593	1.102
MT CHF	Ja	CHF	1.977	0.691	1.286
NT CHF	Ja	CHF	22.391	7.836	14.555
NTH1 CHF	Ja	CHF	2.114	0.739	1.375

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

9 Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		989'030'064.59	764'299'472.40	666'192'824.68	605'392'792.30
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'857'148.67	6'351'333.47	3'897'542.49	5'012'246.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		64'810.742	44'419.380	27'339.148	28'857.322
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		182.9504	142.9856	142.5627	173.6906
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		183.0418	142.8856	142.6625	173.8122
Thesaurierung je Anteil		0.62	0.84	0.63	0.19
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'165'086.14	9'479'563.07	9'165'223.02	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		115'853.275	115'630.275	112'217.275	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		105.0042	81.9817	81.6739	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		105.0568	81.9243	81.7311	
Thesaurierung je Anteil		0.50	0.61	0.53	
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %	0.70 %	
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'288'193.36	8'129'264.98	8'062'150.91	9'766'065.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		56'920.592	64'118.076	64'118.076	64'118.076
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		163.1781	126.7859	125.7391	152.3138
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		163.2597	126.6971	125.8271	152.4204
Thesaurierung je Anteil		1.86	1.84	1.72	1.29
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		734'744'983.74	599'194'540.46	535'563'370.74	532'118'504.00
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		265'667.692	278'824.325	251'251.642	206'057.145
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		2'765.6543	2'149.0038	2'131.5816	2'582.3832
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		2'767.0371	2'147.4995	2'133.0737	2'584.1908
Thesaurierung je Anteil		31.21	30.86	28.89	21.47
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		220'974'652.68	141'144'770.42	109'504'537.52	58'495'977.05
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'816'351.107	1'510'299.618	1'239'266.127	513'898.892
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		121.6586	93.4548	88.3624	113.8278
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		121.7194	93.3894	88.4243	113.9075
Thesaurierung je Anteil		1.38	1.37	1.26	0.86
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 DT CHF	28.18 %	11.03 %	-21.67 %	30.61 %
Klasse GT CHF (Lancierung 10.12.2021)	28.37 %	11.20 %	-21.55 %	0.11 %
Klasse MT CHF	29.43 %	11.83 %	-20.95 %	31.72 %
Klasse NT CHF	29.26 %	11.95 %	-21.02 %	31.70 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2021)	30.75 %	18.28 %	-22.64 %	15.36 %
Benchmark Hedge	28.02 %	18.56 %	-18.11 %	-
Benchmark	27.36 %	12.82 %	-16.87 %	25.65 %
Tracking Error 33)	3.14 %	2.63 %	5.59 %	3.53 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DT CHF	0.82 %
Klasse GT CHF (Lancierung 10.12.2021)	1.01 %
Klasse MT CHF	2.07 %
Klasse NT CHF	1.90 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2021)	2.73 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'556'685.06	42'701'360.57
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	995'469'260.92	721'058'396.34
Derivative Finanzinstrumente	797'989.10	0.00
Sonstige Vermögenswerte	792'391.23	754'567.10
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	998'616'326.31	764'514'324.01
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-9'390'804.12	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-195'457.60	-214'851.61
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	989'030'064.59	764'299'472.40

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		44'419.380	27'339.148
Ausgegebene Anteile		30'516.893	42'989.728
Zurückgenommene Anteile		-10'125.531	-25'909.496
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		64'810.742	44'419.380
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		115'630.275	112'217.275
Ausgegebene Anteile		17'605.000	3'413.000
Zurückgenommene Anteile		-17'382.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		115'853.275	115'630.275
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		64'118.076	64'118.076
Zurückgenommene Anteile		-7'197.484	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		56'920.592	64'118.076
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		278'824.325	251'251.642
Ausgegebene Anteile		66'929.977	108'000.983
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		2'635.361	-
Zurückgenommene Anteile		-82'721.971	-80'428.300
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		265'667.692	278'824.325
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'510'299.618	1'239'266.127
Ausgegebene Anteile		948'952.238	646'820.593
Zurückgenommene Anteile		-642'900.749	-375'787.102
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'816'351.107	1'510'299.618

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	13.12.2023	1'791'051.86	769.475
Klasse NT CHF	13.12.2023	4'343'089.24	1'865.886

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		764'299'472.40	666'192'824.68
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'867'932.07	-3'337'430.73
Saldo aus dem Anteilverkehr		7'478'239.70	86'716'186.00
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		221'120'284.56	14'727'892.45
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		989'030'064.59	764'299'472.40

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		81'576.97	64'399.84
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'694.81	-570.40
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		10'888'764.65	9'870'256.94
Erträge der Gratisaktien		1'641.91	247'200.74
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'633'613.23	1'661'263.99
Total Ertrag		12'603'901.95	11'842'551.11
Aufwand			
Passivzinsen		-48.60	-12.36
Reglementarische Vergütungen		-155'738.66	-115'037.20
Sonstige Aufwendungen		-29'536.14	-84.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'411'956.38	-823'601.60
Total Aufwand		-1'597'279.78	-938'735.16
Nettoertrag / Verlust		11'006'622.17	10'903'815.95
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		75'667'842.99	-3'960'093.02
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		0.00	38'632.36
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		208'167.80	320'423.78
Realisierter Erfolg		86'882'632.96	7'302'779.07
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		134'237'651.60	7'425'113.38
Gesamterfolg		221'120'284.56	14'727'892.45

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF		31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag		40'419.92	37'722.28
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		40'419.92	37'722.28
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		14'146.97	13'202.80
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		26'272.95	24'519.48
Total		40'419.92	37'722.28
Klasse GT CHF		31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag		58'732.53	70'792.50
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		58'732.53	70'792.50
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		20'556.39	24'777.38
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		38'176.14	46'015.12
Total		58'732.53	70'792.50
Klasse MT CHF		31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag		106'143.38	118'501.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		106'143.38	118'501.52
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		37'150.18	41'475.53
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		68'993.20	77'025.99
Total		106'143.38	118'501.52
Klasse NT CHF		31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag		8'293'781.97	8'605'346.17
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		8'293'781.97	8'605'346.17
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		2'902'823.69	3'011'871.16
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		5'390'958.28	5'593'475.01
Total		8'293'781.97	8'605'346.17
Klasse NTH1 CHF		31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag		2'507'544.37	2'071'453.48
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		2'507'544.37	2'071'453.48
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		877'640.53	725'008.72
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1'629'903.84	1'346'444.76
Total		2'507'544.37	2'071'453.48

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							995'469'260.92	99.68	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							995'469'260.92	99.68	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	1'625'971	366'181	1'000'925	991'227 AUD	17.92	10'060'461.13	1.01	a)
AU							10'060'461.13	1.01	
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	0	1'119'828	263'323	856'505 CAD	18.41	9'781'421.03	0.98	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	145'414	84'661	66'067	164'008 CAD	132.80	13'510'809.47	1.35	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	181'292	70'651	100'073	151'870 CAD	50.57	4'764'125.67	0.48	a)
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	0	16'925	16'925	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA							28'056'356.17	2.81	
DE0005664809	EVOTEC SE	132'674	3'284	135'958	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	219'096	49'828	268'924	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	0	60'950	18'074	42'876 EUR	214.80	8'645'746.55	0.87	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	105'080	37'599	85'210	57'469 EUR	178.40	9'624'594.73	0.96	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	60'540	13'724	30'659	43'605 EUR	289.40	11'846'465.08	1.19	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0	7'564	7'564	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1DAH0	BRENNTAG SE	0	41'651	41'651	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	339'134	868'764	212'801	995'097 EUR	12.42	11'597'545.95	1.16	a)
US30050E1055	EVOTEC SE - SPON ADR	33'170	0	33'170	0 USD	0.00	0.00	0.00	
DE							41'714'352.31	4.18	
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	284'070	223'468	507'538	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	170'333	49'407	119'416	100'324 DKK	763.10	9'636'030.68	0.96	a)
DK							9'636'030.68	0.96	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	0	549'237	0	549'237 EUR	9.15	4'717'749.11	0.47	a)
ES							4'717'749.11	0.47	
FR0000120644	DANONE	169'624	80'814	74'054	176'384 EUR	65.70	10'878'738.01	1.09	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	64'986	29'702	18'269	76'419 EUR	237.20	17'016'490.52	1.70	a)
FR							27'895'228.53	2.79	
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	0	1'038'656	86'606	952'050 GBP	644.60	6'822'417.20	0.68	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	28'126	36'030	21'480	42'676 GBP	11'042.00	5'238'653.39	0.52	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	345'887	160'111	186'142	319'856 EUR	5'601.38	16'819'142.69	1.68	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	0	3'877	3'877	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR05C01	NATIONAL GRID PLC	0	1'231'013	155'852	1'075'161 GBP	976.20	11'668'110.16	1.17	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	1'726'297	2'025'503	1'009'540	2'742'260 GBP	367.70	11'209'609.25	1.12	a)
IE00BDVJQJ56	NVENT ELECTRIC PLC	0	158'622	158'622	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB							51'757'932.69	5.18	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	38'210	48'584	40'816	45'978 USD	344.82	13'709'069.64	1.37	a)
IE							13'709'069.64	1.37	
US83417M1045	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	13'025	0	13'025	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IL							0.00	0.00	
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	197'370	78'550	74'003	201'917 EUR	64.82	12'286'717.49	1.23	a)
IT							12'286'717.49	1.23	
JP3200450009	ORIX CORP	0	755'200	316'400	438'800 JPY	3'270.00	8'145'331.89	0.82	a)
JP3201200007	OLYMPUS CORP	0	557'500	275'700	281'800 JPY	2'710.50	4'335'955.47	0.43	a)
JP3358000002	SHIMANO INC	30'293	6'200	36'493	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY GROUP CORP	168'669	785'945	208'569	746'045 JPY	2'723.50	11'534'182.46	1.16	a)
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	66'300	31'800	59'300	38'800 JPY	23'400.00	5'153'971.31	0.52	a)
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	211'900	774'800	403'300	583'400 JPY	3'273.00	10'839'439.94	1.09	a)
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	306'820	110'800	226'700	190'920 JPY	5'568.00	6'034'552.44	0.60	a)
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	700'229	15'800	716'029	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP							46'043'433.51	4.61	
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	34'771	149'470	91'521	92'720 EUR	45.18	3'932'544.18	0.39	a)
LU							3'932'544.18	0.39	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0010273215	ASML HOLDING NV	17'832	6'591	11'827	12'596 EUR	621.20	7'345'444.13	0.74	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	254'280	12'443	241'837 EUR	45.19	10'259'331.17	1.03	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	253'731	256'838	56'677	453'892 EUR	30.31	12'914'940.97	1.29	a)
NL							30'519'716.27	3.06	
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	779'383	89'787	869'170	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0020050417	BOLIDEN AB	262'191	33'248	295'439	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
US0528001094	AUTOLIV INC	73'740	35'128	108'868	0 USD	0.00	0.00	0.00	
SE							0.00	0.00	
SG1M31001969	UNITED OVERSEAS BANK LTD	0	740'900	28'300	712'600 SGD	32.16	14'979'602.88	1.50	a)
SG1S04926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1'402'696	304'200	1'706'896	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG							14'979'602.88	1.50	
IE00059YS762	LINDE PLC	43'890	21'693	19'319	46'264 USD	456.15	18'248'043.92	1.83	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	65'614	11'985	34'686	42'913 USD	331.58	12'303'896.32	1.23	a)
US0010551028	AFLAC INC	206'754	45'894	189'824	62'824 USD	104.79	5'692'602.82	0.57	a)
US00724F1012	ADOBE INC	24'260	3'298	27'558	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0126531013	ALBEMARLE CORP	29'966	20'300	50'266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	270'024	149'840	158'387	261'477 USD	171.11	38'687'827.59	3.87	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	89'900	304'633	153'331	241'202 USD	186.40	38'876'957.66	3.89	a)
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	52'623	22'174	74'797	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0311621009	AMGEN INC	0	71'247	9'660	61'587 USD	320.16	17'049'889.93	1.71	a)
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	12'355	17'296	16'720	12'931 USD	405.76	4'536'979.35	0.45	a)
US0378331005	APPLE INC	171'883	173'835	89'837	255'881 USD	225.91	49'984'914.53	5.01	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	75'903	53'694	57'863	71'734 USD	181.58	11'263'115.02	1.13	a)
US0476491081	ATKORE INC	88'736	14'729	103'465	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	0	307'934	55'445	252'489 USD	75.36	16'453'140.68	1.65	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	14'841	2'557	17'398	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	1'975	0	1'975	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011371077	BOSTON SCIENTIFIC CORP	0	183'424	3'531	179'893 USD	84.02	13'069'603.15	1.31	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	0	226'541	47'548	178'993 USD	169.77	26'276'193.70	2.63	a)
US1167941087	BRUKER CORP	0	94'592	94'592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	0	40'470	14'564	25'906 USD	276.12	6'185'341.53	0.62	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	171'010	43'469	214'479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US15135B1017	CENTENE CORP	81'776	5'305	87'081	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	0	177'133	3'627	173'506 USD	54.77	8'217'178.05	0.82	a)
US21874C1027	CORE & MAIN INC-CLASS A	0	533'195	274'319	258'876 USD	44.28	9'912'081.42	0.99	a)
US22788C1053	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	0	27'903	4'723	23'180 USD	296.87	5'950'386.88	0.60	a)
US23331A1097	DR HORTON INC	0	123'918	30'749	93'169 USD	169.00	13'615'186.60	1.36	a)
US2441991054	DEERE & CO	18'680	795	19'475	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2788651006	ECOLAB INC	0	46'669	20'812	25'857 USD	245.73	5'494'165.98	0.55	a)
US29261A1007	ENCOMPASS HEALTH CORP	66'627	128'300	49'376	145'551 USD	99.46	12'517'831.68	1.25	a)
US3364331070	FIRST SOLAR INC	78'408	40'160	64'797	53'771 USD	194.48	9'042'500.01	0.91	a)
US34379V1035	FLUENCE ENERGY INC	0	184'744	184'744	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	81'985	123'111	121'248	83'848 USD	78.66	5'703'114.74	0.57	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	175'875	89'026	190'206	74'695 USD	88.82	5'736'774.24	0.57	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	0	78'983	78'983	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4435106079	HUBBELL INC	0	37'281	1'341	35'940 USD	427.03	13'270'947.11	1.33	a)
US4657411066	ITRON INC	0	23'016	23'016	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	45'358	6'644	52'002	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	110'507	13'980	124'487	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	0	152'598	152'598	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	33'322	10'380	19'592	24'110 USD	829.74	17'298'350.65	1.73	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	55'083	5'749	60'832	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	73'979	19'699	50'313	43'365 USD	218.24	8'183'501.43	0.82	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	147'615	58'564	56'495	149'684 USD	406.35	52'594'593.56	5.27	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	137'201	115'290	153'477	99'014 USD	99.65	8'531'774.49	0.85	a)
US6098391054	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	0	8'878	1'381	7'497 USD	759.30	4'922'280.62	0.49	a)
US65290E1010	NEXTRACKER INC-CL A	0	382'884	50'692	332'192 USD	39.82	11'438'152.54	1.15	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	66'868	706'745	218'466	555'147 USD	132.76	63'729'527.70	6.38	a)
US6907421019	OWENS CORNING	114'291	31'098	47'078	98'311 USD	176.79	15'028'833.34	1.50	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	0	92'309	0	92'309 USD	165.18	13'184'600.26	1.32	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	0	93'281	8'327	84'954 USD	129.53	9'515'238.02	0.95	a)
US74762E1029	QUANTA SERVICES INC	0	43'153	2'729	40'424 USD	301.63	10'543'365.89	1.06	a)
US7588491032	REGENCY CENTERS CORP	0	112'072	112'072	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	0	15'769	4'390	11'379 USD	838.20	8'247'402.93	0.83	a)
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	32'277	17'351	15'725	33'903 USD	480.36	14'082'197.30	1.41	a)
US8716071076	SYNOPSIS INC	28'424	8'479	36'903	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8725901040	T-MOBILE US INC	69'426	56'999	37'196	89'229 USD	223.16	17'218'203.55	1.72	a)
US88160R1014	TESLA INC	43'509	36'589	80'098	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88162G1031	TETRA TECH INC	0	278'059	33'948	244'111 USD	48.88	10'317'726.37	1.03	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30'555	13'775	32'891	11'439 USD	546.32	5'403'816.82	0.54	a)
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	57'204	12'977	46'565	23'616 USD	265.51	5'421'914.71	0.54	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	20'321	9'817	6'857	23'281 USD	812.80	16'362'542.39	1.64	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	39'626	18'719	21'666	36'679 USD	564.50	17'903'869.02	1.79	a)
US92276F1003	VENTAS INC	0	92'323	92'323	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	51'839	16'837	35'084	33'592 USD	475.98	13'825'792.20	1.38	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	175'071	21'212	153'859 USD	109.29	14'540'146.77	1.46	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	62'611	26'783	34'423	54'971 USD	289.85	13'777'562.86	1.38	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	39'095	4'634	43'729	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US95040Q1040	WELLTOWER INC	0	51'906	51'906	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98419M1009	XYLEM INC	0	55'570	55'570	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US							700'160'066.33	70.11	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
NL0015001578	UNILEVER PLC-DRIP	0	345'887	345'887	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001YU5	UNILEVER PLC	0	308'667	308'667	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001ZB2	NN GROUP NV-SCRIP	0	107'345	107'345	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023K6	UNILEVER PLC	0	324'237	324'237	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL00150026R4	UNILEVER PLC	0	331'939	331'939	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	

Devisentermingeschäfte

USD/CAD	Verfall	13.02.2024	4'200'000	3'126'861	CAD/USD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	27.02.2024	1'580'000	1'170'415	CAD/USD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	15.03.2024	1'300'000	965'274	CAD/USD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	04.04.2024	1'300'000	957'930	CAD/USD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	26.04.2024	14'100'000	83'079	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	26.04.2024	180'000	120'425	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	08.05.2024	820'000	550'088	SGD/CHF	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	08.05.2024	470'000	344'217	CAD/USD	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall	03.07.2024	40'000	23'983	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall	18.07.2024	290'000	175'713	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	18.07.2024	86'000'000	486'905	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	18.07.2024	250'000	166'481	SGD/CHF	0.00	0.00
USD/SGD	Verfall	26.07.2024	780'000	579'408	SGD/USD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall	01.08.2024	274'225	380'000	USD/CAD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	03.10.2024	225'000'000	1'328'076	JPY/CHF	0.00	0.00
USD/JPY	Verfall	08.10.2024	210'000'000	1'428'774	JPY/USD	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	04.12.2023	95'838'243	105'675'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	18'071'398	18'825'000	CHF/EUR	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.12.2023	1'942'071	23'898'000	CHF/SEK	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall	04.12.2023	2'327'344	3'511'000	CHF/SGD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.12.2023	9'203'874	1'529'119'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.12.2023	2'966'491	4'539'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.12.2023	1'275'845	1'159'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.12.2023	2'413'073	4'198'000	CHF/AUD	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.12.2023	3'969'259	30'857'000	CHF/DKK	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.12.2023	199'301	1'546'000	CHF/DKK	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.12.2023	3'733'278	4'166'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.12.2023	60'698	55'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	815'902	847'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.12.2023	2'521'120	2'832'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.12.2023	462'861	78'181'000	CHF/JPY	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.12.2023	87'353	1'039'000	CHF/SEK	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.12.2023	252'495	1'949'000	CHF/DKK	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.12.2023	804'229	134'871'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	907'996	940'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall	04.12.2023	1'000'000	84'528	SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall	04.12.2023	34'352'000	4'370'948	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall	04.12.2023	4'539'000	2'910'861	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	04.12.2023	1'742'171'000	10'246'753	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.12.2023	20'612'000	19'554'604	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	04.12.2023	3'511'000	2'287'452	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.12.2023	112'673'000	97'970'300	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall	04.12.2023	23'937'000	1'986'053	SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	04.12.2023	1'214'000	1'336'298	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall	04.12.2023	4'198'000	2'420'273	AUD/CHF	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.01.2024	4'627'173	36'433'000	CHF/DKK	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.01.2024	2'932'004	4'586'000	CHF/CAD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.01.2024	10'378'719	1'761'936'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	20'042'438	21'171'000	CHF/EUR	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall	04.01.2024	2'306'661	3'548'000	CHF/SGD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.01.2024	100'382'600	115'864'000	CHF/USD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.01.2024	1'994'385	24'083'000	CHF/SEK	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.01.2024	1'381'295	1'259'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.01.2024	2'511'309	4'367'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.01.2024	47'718	74'000	CHF/CAD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	04.01.2024	114'319	178'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.01.2024	68'250	62'000	CHF/GBP	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.01.2024	248'864	1'964'000	CHF/DKK	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.01.2024	95'224	1'137'000	CHF/SEK	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	1'092'247	1'157'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	04.01.2024	68'540'000	413'179	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	04.01.2024	403'000	262'695	SGD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.01.2024	4'402'241	5'029'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	04.01.2024	153'512'000	938'898	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	04.01.2024	308'000	200'737	SGD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.01.2024	126'253	115'000	CHF/GBP	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.01.2024	125'311	1'473'000	CHF/SEK	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		144'000	83'962	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		150'413	233'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		42'430'000	256'019	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		5'071'000	3'236'616	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		38'397'000	4'788'490	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		120'893'000	101'744'758	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		26'693'000	2'228'866	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		1'436'000	1'540'684	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		22'328'000	20'757'225	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		2'837'000	1'810'063	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024	1'497'454'000		8'939'127	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		4'223'000	2'425'142	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		3'329'157	5'230'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		5'207'503	41'827'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		107'777'290	128'458'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		2'226'434	26'717'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		1'595'039	1'491'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		21'797'017	23'491'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		1'888'305	2'965'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		9'209'590	1'540'480'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		2'474'847	4'319'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		1'163'000	96'539	SEK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		322'191	55'065'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		594'000	49'385	SEK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		631'803	107'745'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		904'000	74'517	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		3'755'000	473'494	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		217'000	237'602	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		1'666'000	137'440	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		1'547'000	128'715	SEK/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		4'239'328	4'888'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		172'189	268'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		219'931	1'757'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		30'308'342	35'111'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		441'119	5'337'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		442'280	687'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		2'276'033	389'761'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		1'329'692	10'596'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		635'289	581'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		894'170	1'391'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		6'025'472	6'441'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		577'714	1'017'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		26'180'000	2'173'987	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		50'425'000	6'304'638	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024	2'093'051'000		12'282'860	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		1'855'000	2'026'495	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		168'457'000	144'517'576	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		29'932'000	27'892'134	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		3'652'000	2'344'219	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		5'336'000	3'026'099	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		6'889'000	4'423'496	CAD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		2'125'984	25'656'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		6'185'084	49'556'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		141'856'240	165'918'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		27'557'149	29'633'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		12'550'876	2'135'545'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		2'370'301	3'700'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		2'008'205	1'844'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		2'996'170	5'296'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		4'328'541	6'761'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		293'559	2'339'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		3'195'000	263'102	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		571'704	881'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		1'246'288	1'324'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		104'000	114'645	GBP/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		100'962	1'210'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		104'114	159'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		95'689	86'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		216'589	375'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		581'305	98'902'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		1'150'000	97'612	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		5'385'000	459'707	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		457'620	702'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		1'936'000	165'514	SEK/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		97'000	108'308	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		1'805'000	230'881	DKK/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		237'669	416'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		161'513	249'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		307'959	2'409'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		92'387	83'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		1'812'357	1'902'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		9'646'906	10'964'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		3'068'000	261'010	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		2'234'447'000	13'145'252	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		32'859'000	31'312'984	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		8'593'000	5'578'919	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		6'087'000	3'490'286	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		12'132'000	1'032'555	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		52'499'000	6'711'472	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		176'882'000	155'760'520	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.03.2024		3'859'000	2'527'298	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		1'812'000	2'018'405	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.04.2024		2'050'000	269'247	DKK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		13'373'184	2'269'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		30'546'602	32'120'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		5'487'506	8'476'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		3'443'259	6'019'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		962'093	11'327'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		6'568'908	51'472'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		151'153'022	172'210'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		2'506'660	3'835'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		1'966'674	1'771'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		503'852	85'316'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		94'181	84'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		855'601	144'748'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		60'237	703'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		362'939	2'821'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		96'326	86'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.04.2024		1'460'000	188'109	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		74'766'000	443'535	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.04.2024		1'344'000	114'150	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		302'565	463'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		44'251	520'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		184'931	316'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		694'954	117'055'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		459'670	696'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		1'971'000	1'930'600	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		171'098'000	1'024'023	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		22'000	25'140	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.04.2024		765'000	65'214	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		355'000	209'632	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		11'115'000	10'060'998	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.04.2024		106'000	71'195	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		653'000	434'978	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		5'980'000	3'514'147	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.04.2024		50'783'000	6'623'119	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		161'095'000	145'106'321	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		8'982'000	5'978'599	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.04.2024		3'729'000	2'488'809	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		2'371'155'000	14'112'166	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		30'149'000	29'328'947	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		1'919'000	2'183'553	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.04.2024		10'441'000	879'654	SEK/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		3'333'008	5'686'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		6'342'956	48'726'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		139'843'698	155'776'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		5'779'352	8'708'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		2'355'259	3'536'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		27'705'405	28'541'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		2'116'503	1'866'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		855'466	10'176'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		28'268	335'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		57'777	675'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		39'502	462'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		315'330	475'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		53'040	628'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		168'119	148'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		1'117'000	1'082'857	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		46'000	52'148		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2024		267'000	155'947		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2024		81'000	54'129		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2024		2'612'000	339'479		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		8'132'000	7'406'365		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2024		1'492'000	193'900		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2024		265'000	22'080		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		1'617'000	1'574'138		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		140'194	123'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2024		409'000	244'403		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		137'000	156'616		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2024		3'455'000	2'323'453		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2024		12'011'000	1'003'519		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2024		1'969'037'000	11'476'532		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2024		9'183'000	6'130'663		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		1'954'000	2'244'091		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		147'644'000	135'419'077		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		25'807'000	25'310'215		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2024		44'622'000	5'867'347		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2024		5'010'000	2'983'856		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		13'586'975	2'279'797'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		62'057'000	366'660		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		178'544'000	1'050'821		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 07.05.2024		70'159'000	408'346		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.06.2024		5'890'454	8'850'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		133'423'822	145'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.06.2024		226'457	343'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		6'870'213	7'588'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.06.2024		287'855	432'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		4'771'641	5'253'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		2'356'057	3'511'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		1'008'062	12'092'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		11'400'680	1'953'968'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		2'204'346	1'926'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		25'159'065	25'713'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		5'808'061	44'261'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		2'972'985	5'005'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		142'579	213'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		852'854	875'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		203'719	1'554'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		1'207'669	1'235'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		137'558	121'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		196'076	1'492'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		122'028	182'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		593'663	101'934'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		575'968	98'658'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		129'867	214'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		65'034	764'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		27'823'000	27'249'846		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		9'625'000	6'370'306		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		5'219'000	3'131'400		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.06.2024		3'906'000	2'607'060		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		47'307'000	6'210'936		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		2'154'560'000	12'368'467		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		12'856'000	1'102'788		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		2'047'000	2'351'061		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		158'821'000	143'272'424		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 28.06.2024		27'198'072	27'817'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 28.06.2024		6'273'344	9'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 28.06.2024		3'032'861	5'065'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 28.06.2024		2'555'571	3'835'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 28.06.2024		6'362'560	48'531'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 28.06.2024		12'602'637	2'193'388'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 28.06.2024		1'100'281	12'847'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 28.06.2024		2'388'532	2'085'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.06.2024		145'845'841	162'132'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 28.06.2024		576'000	49'405		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 28.06.2024		409'000	265'847		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 28.06.2024		436'000	283'550		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 28.06.2024		219'000	141'923		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 28.06.2024		518'000	43'868		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 28.06.2024		3'303'000	420'432		DKK/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 28.06.2024		524'931	463'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 28.06.2024		414'891	366'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AUD/CHF	Verfall 28.06.2024		93'165	157'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 28.06.2024	2'193'388'000		12'250'949	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 28.06.2024		5'222'000	3'116'020	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 28.06.2024	27'817'000		26'658'422	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 28.06.2024	45'228'000		5'810'441	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 28.06.2024	3'835'000		2'532'672	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 28.06.2024	8'436'000		5'526'255	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 28.06.2024	162'132'000		145'450'239	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 28.06.2024	2'914'000		3'299'930	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 28.06.2024	11'753'000		998'417	SEK/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 31.07.2024	12'399'595		2'217'631'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 31.07.2024		3'221'216	5'415'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 31.07.2024	26'587'417		27'810'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 31.07.2024	6'070'223		47'350'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 31.07.2024	2'592'327		3'935'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 31.07.2024	5'630'491		8'623'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.07.2024	148'664'196		166'372'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 31.07.2024	3'306'643		2'931'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 31.07.2024	1'013'715		11'961'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	5'005'000		644'839	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 31.07.2024	1'083'000		1'040'190	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 31.07.2024		78'000	46'667	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 31.07.2024	102'000		115'521	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 31.07.2024	615'000		52'010	SEK/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 31.07.2024	153'397		134'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 31.07.2024	159'282		240'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	2'683'000		349'147	DKK/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 31.07.2024	359'978		549'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.07.2024	3'915'422		4'382'000	CHF/USD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 31.07.2024	161'535		1'242'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 31.07.2024	1'030'000		1'062'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 31.07.2024	418'476		74'991'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 31.07.2024	84'407		991'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 31.07.2024	378'001		570'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 31.07.2024	1'498'862		1'306'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 31.07.2024	1'197'531		1'228'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 31.07.2024	214'581		328'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.07.2024	5'724'714		6'397'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 31.07.2024	142'285		239'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	2'968'000		383'798	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 31.07.2024	178'000		117'278	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 31.07.2024	1'229'000		101'873	SEK/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 31.07.2024	887'185		771'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 31.07.2024	111'810'000		644'577	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	6'274'000		806'291	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 31.07.2024	8'018'000		7'050'580	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 31.07.2024	124'882'000		716'373	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	1'393'000		179'034	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 31.07.2024	4'567'000		3'012'119	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 31.07.2024	11'108'000		909'079	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 31.07.2024	5'576'000		3'229'563	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 31.07.2024	29'017'000		27'817'147	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 31.07.2024	30'269'000		3'889'264	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 31.07.2024	169'133'000		149'912'726	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 31.07.2024	5'040'000		5'738'746	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 31.07.2024	2'055'930'000		11'830'027	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 31.07.2024	9'500'000		6'078'765	CAD/CHF		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 30.08.2024	3'067'563		4'661'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 30.08.2024	938'033		11'486'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 30.08.2024	3'298'988		5'712'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 30.08.2024	28'430'009		29'721'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 30.08.2024	3'871'106		30'185'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.08.2024	150'738'935		170'674'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 30.08.2024	5'945'589		5'239'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 30.08.2024	11'810'806		2'050'651'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 30.08.2024	6'005'976		9'412'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 30.08.2024	7'141'000		6'041'979	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 30.08.2024	1'437'000		1'335'281	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 30.08.2024	2'461'000		306'584	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 30.08.2024	200'284'000		1'187'157	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 30.08.2024	470'000		37'905	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 30.08.2024	121'495'000		716'141	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 30.08.2024	466'000		258'495	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 30.08.2024	309'000		198'529	SGD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/CAD Verfall 30.08.2024		412'000	258'641		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 30.08.2024		514'000	42'155		SEK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.08.2024		1'276'795	1'337'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.08.2024		240'323	380'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.08.2024		310'503	471'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.08.2024		804'096	136'388'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.08.2024		6'511'310	7'551'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.08.2024		307'858	490'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.08.2024		462'114	78'513'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.08.2024		100'490	174'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.08.2024		139'718	213'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.08.2024		73'338	877'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.08.2024		355'918	319'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.08.2024		217'971	1'709'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.08.2024		7'021'902	8'204'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.08.2024		1'197'510	1'265'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 30.08.2024		5'990'000	498'248		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.08.2024		558'604	892'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.08.2024		179'288'000	150'953'324		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.08.2024		1'943'773'000	11'324'616		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 30.08.2024		29'433'000	3'698'551		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.08.2024		5'558'000	6'183'775		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.08.2024		30'886'000	28'943'271		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 30.08.2024		5'420'000	3'098'993		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 30.08.2024		5'036'000	3'257'083		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 30.08.2024		10'762'000	6'734'214		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 30.08.2024		5'389'000	445'940		SEK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.08.2024		154'465'655	184'131'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.09.2024		11'526'003	1'976'721'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.09.2024		6'309'442	5'690'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 30.09.2024		3'659'872	29'180'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.09.2024		29'975'192	32'058'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.09.2024		3'273'930	5'072'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.09.2024		3'221'878	5'651'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.09.2024		91'232'000	533'087		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.09.2024		197'000	218'696		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.09.2024		72'995'000	432'143		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.09.2024		6'673'000	5'611'212		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.09.2024		69'582'000	413'343		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.09.2024		298'290	268'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 30.09.2024		170'963	262'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.09.2024		204'682	360'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.09.2024		6'075'818	7'178'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.09.2024		73'280'000	436'701		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 30.09.2024		1'742'000	221'298		DKK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.09.2024		416'850	70'695'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.09.2024		1'073'397	949'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.09.2024		184'636'000	156'480'856		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 30.09.2024		5'334'000	3'520'920		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.09.2024		1'740'327'000	10'186'656		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 30.09.2024		6'011'000	3'509'102		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.09.2024		6'710'000	7'619'943		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 30.09.2024		27'438'000	3'482'705		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.09.2024		32'058'000	30'341'294		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.10.2024		6'947'627	11'134'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.10.2024		388'000	241'009		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.10.2024		459'487	737'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.10.2024		1'294'000	812'560		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.10.2024		10'189'000	6'411'632		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.10.2024		158'229'829	187'360'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 31.10.2024		10'079'226	1'720'718'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 31.10.2024		3'463'476	5'951'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 31.10.2024		7'532'861	6'657'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 31.10.2024		6'366'080	10'144'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 31.10.2024		3'381'423	26'692'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 31.10.2024		30'234'918	32'018'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 31.10.2024		592'787	527'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 31.10.2024		1'068'000	134'579		DKK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 31.10.2024		908'943	153'824'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 31.10.2024		289'000	168'848		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 31.10.2024		3'677'000	462'493		DKK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 31.10.2024		528'500	91'362'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 31.10.2024		4'205'000	527'496		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 31.10.2024		94'000'000	535'720		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 31.10.2024		811'000	466'450		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.10.2024		187'360'000	162'720'286		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 31.10.2024		1'871'904'000	10'592'543		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 31.10.2024		7'184'000	8'113'179		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 31.10.2024		10'144'000	6'333'406		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 31.10.2024		17'742'000	2'230'169		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 31.10.2024		4'851'000	2'762'693		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 31.10.2024		32'018'000	30'024'880		EUR/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.11.2024		3'505'798	5'322'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 01.11.2024		5'322'000	3'487'347		SGD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.11.2024		161'481'608	186'522'000		CHF/USD	681'695.02	0.07	b)
	JPY/CHF Verfall 29.11.2024		10'484'885	1'851'789'000		CHF/JPY	-33'917.10	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 29.11.2024		8'180'607	7'267'000		CHF/GBP	126'867.77	0.01	b)
	SGD/CHF Verfall 29.11.2024		3'382'943	5'172'000		CHF/SGD	8'624.35	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 29.11.2024		6'377'557	10'238'000		CHF/CAD	40'594.66	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 29.11.2024		2'141'002	17'061'000		CHF/DKK	-2'976.60	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 29.11.2024		2'730'983	4'809'000		CHF/AUD	14'718.09	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 29.11.2024		31'014'144	33'137'000		CHF/EUR	-34'953.48	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 29.11.2024		659'000	374'887		AUD/CHF	-2'663.61	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							797'989.10	0.08	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'556'685.06	0.16
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	995'469'260.92	99.68
Derivative Finanzinstrumente	797'989.10	0.08
Sonstige Vermögenswerte	792'391.23	0.08
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	998'616'326.31	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-9'390'804.12	
Andere Verbindlichkeiten	-195'457.60	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	989'030'064.59	

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);	995'469'260.92	99.68
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	797'989.10	0.08
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
HKD	100 = CHF	11.12240200
HUF	100 = CHF	0.22992000
JPY	100 = CHF	0.56766800
NOK	100 = CHF	7.83924400
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
USD	1 = CHF	0.86470000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	373'243.43	0.038
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	225'586'596.45	22.809

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.850	1.250	0.670	0.180	2.000
GT CHF	0.700	1.050	0.520	0.180	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

MSCI® World ex Switzerland Index TR Net

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.

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	0.62366	0.21828	0.40538
GT CHF	Ja	CHF	0.50695	0.17743	0.32952
MT CHF	Ja	CHF	1.864	0.652	1.212
NT CHF	Ja	CHF	31.218	10.926	20.292
NTH1 CHF	Ja	CHF	1.380	0.483	0.897

Sonderausschüttung 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Sonderausschüttung der ausländischen Quellensteuer

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	CHF	0.400	0.140	0.260

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

10 Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Übersicht

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022	01.11.2020 31.10.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		955'813'390.79	1'033'530'056.89	550'945'729.77	493'612'991.37
Klasse AA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'120'149.29	2'822'693.04	2'803'037.99	1'229'794.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		18'626.639	18'567.140	17'589.290	6'440.043
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		167.5101	152.0263	159.3605	190.9607
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		167.3928	152.1175	159.4720	190.7888
Ausschüttung je Anteil		1.50	1.50	1.25	3.60
Total Expense Ratio (TER)		1.70 %	1.70 %	1.70 %	1.70 %
Klasse BA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		106'162.67	143'259.00	6'666'254.99	7'290'853.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'152.000	1'717.000	76'418.995	71'641.471
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		92.1551	83.4356	87.2330	101.7686
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.0906	83.4857	87.2940	101.6770
Ausschüttung je Anteil		1.25	1.20	1.05	-
Total Expense Ratio (TER)		1.03 %	1.03 %	1.03 %	1.03 %
Klasse CA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'167'347.28	1'092'410.90	1'425'843.32	1'403'017.34
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'732.987	10'056.955	12'546.775	10'330.047
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		119.9372	108.6224	113.6422	135.8191
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		119.8533	108.6876	113.7218	135.6968
Ausschüttung je Anteil		1.70	1.70	1.55	3.20
Total Expense Ratio (TER)		0.94 %	0.94 %	0.94 %	0.94 %
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		42'246'324.49	63'305'567.78	58'758'843.20	52'064'467.54
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		228'494.291	381'943.028	342'063.691	257'906.244
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		184.8901	165.7461	171.7775	201.8736
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		184.7606	165.8455	171.8977	201.6919
Thesaurierung je Anteil		2.79	2.78	2.41	4.99
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		486'199'590.91	479'148'071.14	79'154'039.84	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'896'315.541	5'388'607.325	859'066.250	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		99.2991	88.9187	92.1396	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.2296	88.9721	92.2041	
Thesaurierung je Anteil		1.66	1.65	1.71	
Total Expense Ratio (TER)		0.68 %	0.68 %	0.68 %	
Klasse MT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'247.60	104'820.13	211'605.01	247'255.27
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000	960.000	1'880.000	1'880.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		122.4760	109.1876	112.5559	131.5188
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		122.3903	109.2531	112.6346	131.4004
Thesaurierung je Anteil		2.85	2.80	2.62	4.25
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		422'961'568.55	486'913'234.90	401'926'105.42	431'377'603.05
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		93'710.510	121'009.974	96'899.331	89'004.626
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		4'513.4913	4'023.7446	4'147.8729	4'846.6874
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		4'510.3318	4'026.1589	4'150.7764	4'842.3254
Thesaurierung je Anteil		105.27	103.51	96.70	156.90
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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	11.08 %	0.10 %	-19.05 %	23.92 %
Klasse BA CHF (Lancierung 13.10.2021)	11.83 %	0.77 %	-18.49 %	6.82 %
Klasse CA CHF	11.93 %	0.87 %	-18.44 %	24.87 %
Klasse DT CHF	12.17 %	1.09 %	-18.41 %	24.98 %
Klasse GT CHF (Lancierung 03.03.2022)	12.36 %	1.26 %	-7.94 %	-
Klasse MT CHF	12.98 %	1.82 %	-17.66 %	26.04 %
Klasse NT CHF	13.13 %	1.95 %	-17.72 %	26.05 %
Benchmark	15.39 %	6.09 %	-16.48 %	23.38 %
Tracking Error 33)	2.60 %	3.48 %	2.24 %	2.50 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse AA CHF	-4.31 %
Klasse BA CHF (Lancierung 13.10.2021)	-3.56 %
Klasse CA CHF	-3.46 %
Klasse DT CHF	-3.22 %
Klasse GT CHF (Lancierung 03.03.2022)	-3.03 %
Klasse MT CHF	-2.41 %
Klasse NT CHF	-2.26 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	21'411'207.52	38'637'226.11
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	931'191'922.47	992'158'416.35
Sonstige Vermögenswerte	3'533'228.91	3'071'979.24
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	956'136'358.90	1'033'867'621.70
Andere Verbindlichkeiten	-322'968.11	-337'564.81
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	955'813'390.79	1'033'530'056.89

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		18'567.140	17'589.290
Ausgegebene Anteile		3'975.062	2'111.850
Zurückgenommene Anteile		-3'915.563	-1'134.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		18'626.639	18'567.140
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'717.000	76'418.995
Ausgegebene Anteile		195.000	13'251.425
Zurückgenommene Anteile		-760.000	-87'953.420
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'152.000	1'717.000
Klasse CA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'056.955	12'546.775
Ausgegebene Anteile		565.239	670.000
Zurückgenommene Anteile		-889.207	-3'159.820
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'732.987	10'056.955
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		381'943.028	342'063.691
Ausgegebene Anteile		96'601.474	134'199.150
Zurückgenommene Anteile		-250'050.211	-94'319.813
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		228'494.291	381'943.028
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'388'607.325	859'066.250
Ausgegebene Anteile		1'340'796.519	4'759'211.200
Zurückgenommene Anteile		-1'833'088.303	-229'670.125
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'896'315.541	5'388'607.325
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		960.000	1'880.000
Zurückgenommene Anteile		-860.000	-920.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000	960.000
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		121'009.974	96'899.331
Ausgegebene Anteile		16'259.746	37'064.604
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	3'891.994
Zurückgenommene Anteile		-43'559.210	-16'845.955
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		93'710.510	121'009.974

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'033'530'056.89	550'945'729.77
Ausbezahlte Ausschüttung		-47'776.03	-117'397.71
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-8'260'450.42	-6'507'843.04
Saldo aus dem Anteilverkehr		-196'506'025.43	520'557'674.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		127'097'585.78	-31'348'106.95
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		955'813'390.79	1'033'530'056.89

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		104'714.20	81'748.30
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		25'333'117.17	22'855'335.08
Erträge der Gratisaktien		0.00	216.14
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'862'724.87	4'167'989.18
Total Ertrag		27'300'556.24	27'105'288.70
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-3'904'538.17	-3'442'949.91
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		6'282.18	5'931.82
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-4'706'117.64	-1'124'409.89
Total Aufwand		-8'604'373.63	-4'561'427.98
Nettoertrag / Verlust		18'696'182.61	22'543'860.72
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		19'067'486.03	-13'104'933.61
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		2'322'737.63	1'915'237.40
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		302'667.13	424'491.56
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		-6'282.18	-5'931.82
Realisierter Erfolg		40'382'791.22	11'772'724.25
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		86'714'794.56	-43'120'831.20
Gesamterfolg		127'097'585.78	-31'348'106.95

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	27'386.67	28'005.53
Vortrag des Vorjahres	582.77	427.95
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	27'969.44	28'433.48
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	27'939.96	27'850.71
Vortrag auf neue Rechnung	29.48	582.77
Total	27'969.44	28'433.48
Klasse BA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	1'388.58	1'583.38
Vortrag des Vorjahres	82.81	559.83
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'471.39	2'143.21
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'440.00	2'060.40
Vortrag auf neue Rechnung	31.39	82.81
Total	1'471.39	2'143.21
Klasse CA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	16'577.57	17'239.51
Vortrag des Vorjahres	363.01	220.32
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	16'940.58	17'459.83
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	16'546.08	17'096.82
Vortrag auf neue Rechnung	394.50	363.01
Total	16'940.58	17'459.83
Klasse DT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	638'311.44	1'063'186.30
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	638'311.44	1'063'186.30
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	223'409.00	372'115.21
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	414'902.44	691'071.09
Total	638'311.44	1'063'186.30
Klasse GT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	8'147'053.64	8'904'493.27
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'147'053.64	8'904'493.27
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'851'468.77	3'116'572.64
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	5'295'584.87	5'787'920.63
Total	8'147'053.64	8'904'493.27
Klasse MT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	285.59	2'696.71
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	285.59	2'696.71
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	99.96	943.85
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	185.63	1'752.86
Total	285.59	2'696.71
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	9'865'179.12	12'526'656.02
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	9'865'179.12	12'526'656.02
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'452'812.69	4'384'329.61
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'412'366.43	8'142'326.41
Total	9'865'179.12	12'526'656.02

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							931'191'922.47	97.39	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							931'191'922.47	97.39	
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	0	932	0	932 CHF	2'275.00	2'120'300.00	0.22	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	111'635	0	111'635	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	75'195	8'366	83'561	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	5'235	0	5'235	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0	45	1	44 CHF	100'400.00	4'417'600.00	0.46	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1'280	926	532	1'674 CHF	10'170.00	17'024'580.00	1.78	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	10'051	4'344	9'290	5'105 CHF	4'097.00	20'915'185.00	2.19	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	0	22'134	237	21'897 CHF	294.20	6'442'097.40	0.67	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	0	1'333	1'333	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	172'115	22'017	94'687	99'445 CHF	510.80	50'796'506.00	5.31	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	1'879'271	91'834	847'751	1'123'354 CHF	93.80	105'370'605.20	11.02	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	524'567	173'325	286'443	411'449 CHF	267.90	110'227'187.10	11.53	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	0	23'662	23'662	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012214059	HOLCIM LTD	241'610	590'577	581'649	250'538 CHF	85.08	21'315'773.04	2.23	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	0	1'246'430	286'856	959'574 CHF	47.90	45'963'594.60	4.81	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	0	65'141	20'891	44'250 CHF	165.90	7'341'075.00	0.77	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	0	265'350	163'077	102'273 CHF	59.75	6'110'811.75	0.64	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	0	147'304	96'499	50'805 CHF	315.20	16'013'736.00	1.67	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	0	145'762	1'561	144'201 CHF	77.20	11'132'317.20	1.16	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	19'651	152'030	110'046	61'635 CHF	532.60	32'826'801.00	3.43	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	10'476	4'783	5'114	10'145 CHF	1'130.00	11'463'850.00	1.20	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	58'001	10'990	51'833	17'158 CHF	704.40	12'086'095.20	1.26	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	81'951	0	81'951	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	28'641	5'084	33'725	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0023405456	AVOLTA AG	0	181'813	181'813	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	0	41'991	20'837	21'154 CHF	1'193.00	25'236'722.00	2.64	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	0	64'661	3'685	60'976 CHF	251.40	15'329'366.40	1.60	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	125'956	105'410	20'546 CHF	215.60	4'429'717.60	0.46	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	0	14'033	150	13'883 CHF	635.00	8'815'705.00	0.92	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	68'428	275'567	343'995	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	0	13'424	13'424	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0038863350	NESTLE SA-REG	2'286'299	111'470	1'046'392	1'351'377 CHF	81.58	110'245'335.66	11.53	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	7'170'966	5'839'677	5'977'129	7'033'514 CHF	1.53	10'733'142.36	1.12	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	363'902	14'004	334'906	43'000 CHF	110.65	4'757'950.00	0.50	a)
CH0130293662	BKW AG	183'660	9'509	85'420	107'749 CHF	151.60	16'334'748.40	1.71	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	132'608	39'988	172'596	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	60'530	431'666	300'464	191'732 CHF	125.35	24'033'606.20	2.51	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	1'586'974	1'550'056	1'389'002	1'748'028 CHF	26.54	46'392'663.12	4.85	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	0	28'044	300	27'744 CHF	359.50	9'973'968.00	1.04	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	78'308	34'501	31'537	81'272 CHF	203.40	16'530'724.80	1.73	a)
CH0360674466	GALENICA AG	289'837	116'398	213'881	192'354 CHF	75.20	14'465'020.80	1.51	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	0	15'710	15'710	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0371153492	LANDIS + GYR GROUP AG	0	57'273	57'273	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0418792922	SIKA AG-REG	0	218'111	93'697	124'414 CHF	240.50	29'921'567.00	3.13	a)
CH0432492467	ALCON INC	534'916	188'891	335'315	388'492 CHF	79.58	30'916'193.36	3.23	a)
CH0435377954	SIG GROUP AG	468'948	380'318	429'078	420'188 CHF	18.59	7'811'294.92	0.82	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	307'927	95'156	53'083	350'000 CHF	7.80	2'730'000.00	0.29	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	33'065	748	33'813	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1107979838	R&S GROUP HOLDING AG	0	285'000	5'000	280'000 CHF	20.90	5'852'000.00	0.61	a)
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	0	129'715	55'113	74'602 CHF	62.70	4'677'545.40	0.49	a)
CH1169360919	ACCELLERON INDUSTRIES AG	360'007	238'954	411'143	187'818 CHF	46.28	8'692'217.04	0.91	a)
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	0	71'347	0	71'347 CHF	114.00	8'133'558.00	0.85	a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	0	108'534	65'034	43'500 CHF	68.35	2'973'225.00	0.31	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	451'629	222'134	297'526	376'237	CHF	39.35	14'804'925.95	1.55 a)
CH1256740924	SGS SA-REG	0	256'035	94'385	161'650	CHF	91.50	14'790'975.00	1.55 a)
CH1335392721	GALDERMA GROUP AG	0	388'647	252'010	136'637	CHF	80.81	11'041'635.97	1.15 a)
CH							931'191'922.47	97.39	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
CH1326854028	SGS SA	0	47'722	47'722	0	CHF	0.00	0.00	0.00
Diverse							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	

Futures

		Anz / Nom in Tsd.	Kauf Zugang	Verkauf Abgang	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung	Kurs	Kurswert CHF	in % 7)
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	97	97	0	CHF	0.00	0.00
09/24	SWISS MKT IX FUTR SEP24	0	58	58	0	CHF	0.00	0.00
12/24	SWISS MKT IX FUTR DEC24	0	28	0	28	CHF	0.00	0.00 a)
							0.00	0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	21'411'207.52	2.24
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	931'191'922.47	97.39
Sonstige Vermögenswerte	3'533'228.91	0.37
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	956'136'358.90	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-322'968.11	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	955'813'390.79	

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);	931'191'922.47	97.39
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	3'302'017.60	0.345
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.700	2.200	1.350	0.350	2.000
BA CHF	1.030	1.650	0.680	0.350	2.000
CA CHF	0.940	1.450	0.590	0.350	2.000
DT CHF	0.850	1.300	0.670	0.180	2.000
GT CHF	0.680	1.100	0.500	0.180	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Swiss Performance Index (SPI)® Total Return

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	1.50000	0.52500	0.97500
BA CHF	Nein	CHF	1.25000	0.43750	0.81250
CA CHF	Nein	CHF	1.70000	0.59500	1.10500

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	2.793	0.977	1.816
GT CHF	Nein	CHF	1.663	0.582	1.081
MT CHF	Nein	CHF	2.855	0.999	1.856
NT CHF	Nein	CHF	105.27	36.84	68.43

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.
- 4) Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenössischen Steuerverwaltung.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

11 Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		492'878'545.73	302'160'037.47	291'533'952.96	309'888'837.88
Klasse DA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		421'422.29	1'115'915.27	2'086'803.95	2'531'082.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'987.020	9'973.241	18'262.788	19'846.532
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		141.0845	111.8909	114.2654	127.5327
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		141.1692	111.8238	114.3339	127.6348
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.50	1.50	1.40
Total Expense Ratio (TER)		-	-	0.50	0.50
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	-	-
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'688'917.15	1'980'915.60	1'782'608.41	2'184'616.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'842.733	12'957.430	11'521.430	12'740.430
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		194.2476	152.8787	154.7211	171.4712
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		194.3641	152.7870	154.8139	171.6084
Thesaurierung je Anteil		2.18	2.04	1.88	2.02
Total Expense Ratio (TER)		-	-	0.50	0.51
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	-	-
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'519'174.66	25'224'289.28	27'716'472.29	32'854'916.74
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		149'051.261	185'721.621	199'828.068	212'228.563
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		171.2107	135.8177	138.7016	154.8091
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		171.3135	135.7362	138.7848	154.9330
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.55	1.55	1.40
Total Expense Ratio (TER)		-	-	0.70	0.70
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.70 %	0.70 %	-	-
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'680'187.64	1'998'993.41	2'928'425.18	3'095'725.34
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'420.000	14'250.000	20'639.956	19'701.268
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		178.3639	140.2802	141.8814	157.1333
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		178.4709	140.1961	141.9665	157.2590
Thesaurierung je Anteil		2.17	2.01	1.87	1.99
Total Expense Ratio (TER)		-	-	0.40	0.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	-	-
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		405'759'768.41	258'207'416.47	257'019'643.13	269'222'496.49
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		133'299.114	108'145.064	106'684.628	101'169.979
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		3'043.9795	2'387.6024	2'409.1535	2'661.0908
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		3'045.8059	2'386.1699	2'410.5990	2'663.2196
Thesaurierung je Anteil		47.86	43.09	40.92	40.79
Total Expense Ratio (TER)		-	-	0.00%	0.00 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %	0.00 %	-	-
Klasse NT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		22'633'598.37	13'632'507.44		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		187'451.000	144'217.000		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		139.6370	103.8709		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		139.7207	103.8086		
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		1.92	1.17		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %	0.00 %		

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		34'175'477.21			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		313'829.201			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		108.8983			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		108.9637			
Thesaurierung je Anteil		0.97			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %			

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 DA CHF	27.58 %	12.03 %	-17.01 %	28.00 %
Klasse DT CHF	27.58 %	12.03 %	-17.00 %	28.00 %
Klasse FA CHF	27.48 %	11.67 %	-17.12 %	27.74 %
Klasse GT CHF	27.71 %	12.14 %	-16.92 %	28.13 %
Klasse NT CHF	28.19 %	12.56 %	-16.62 %	28.52 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	34.94 %	18.98 %	-	-
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2024)	8.96 %	-	-	-
Benchmark Hedge	8.37 %	-	-	-
Benchmark	27.36 %	12.82 %	-16.87 %	25.65 %
Tracking Error 33)	0.91 %	1.04 %	1.33 %	1.61 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DA CHF	0.22 %
Klasse DT CHF	0.22 %
Klasse FA CHF	0.12 %
Klasse GT CHF	0.35 %
Klasse NT CHF	0.83 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	7.58 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2024)	0.59 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	22'616'828.14	15'189'851.99
Bankguthaben auf Zeit	5'188'200.00	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	455'639'809.57	271'506'267.36
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	14'679'410.53	15'311'826.96
Sonstige Vermögenswerte	586'380.19	450'540.68
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	498'710'628.43	302'458'486.99
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-5'692'017.13	-160'460.69
Andere Verbindlichkeiten	-140'065.57	-137'988.83
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	492'878'545.73	302'160'037.47

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'973.241	18'262.788
Ausgegebene Anteile		315.000	-
Zurückgenommene Anteile		-7'301.221	-8'289.547
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'987.020	9'973.241

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'957.430	11'521.430
Ausgegebene Anteile		3'481.303	2'945.000
Zurückgenommene Anteile		-2'596.000	-1'509.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'842.733	12'957.430

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		185'721.621	199'828.068
Ausgegebene Anteile		6'257.214	3'938.944
Zurückgenommene Anteile		-42'927.574	-18'045.391
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		149'051.261	185'721.621

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'250.000	20'639.956
Ausgegebene Anteile		1'000.000	-
Zurückgenommene Anteile		-5'830.000	-6'389.956
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'420.000	14'250.000

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		108'145.064	106'684.628
Ausgegebene Anteile		53'328.340	33'897.326
Zurückgenommene Anteile		-28'174.290	-32'436.890
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		133'299.114	108'145.064

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	Lancierung 27.03.2023 31.10.2023
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		144'217.000	-
Ausgegebene Anteile		58'885.000	159'292.000
Zurückgenommene Anteile		-15'651.000	-15'075.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		187'451.000	144'217.000

	von bis	Lancierung 30.04.2024 31.10.2024
Klasse NTH1 CHF		
Ausgegebene Anteile		365'907.785
Zurückgenommene Anteile		-52'078.584
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		313'829.201

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		302'160'037.47	291'533'952.96
Ausbezahlte Ausschüttung		-284'246.76	-320'492.39
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'818'560.79	-1'628'283.42
Saldo aus dem Anteilverkehr		103'042'269.67	10'820'176.39
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		89'779'046.14	1'754'683.93
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		492'878'545.73	302'160'037.47

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		304'839.98	153'942.62
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2'178.25	-1'700.58
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		6'138'024.78	4'984'175.35
Erträge der Gratisaktien		36'966.19	5'891.19
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		224'561.63	234'838.43
Erträge aus Wertpapierleihe		25'223.30	25'339.95
Sonstige Erträge		4'556.24	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'428'848.27	510'431.53
Total Ertrag		8'160'842.14	5'912'918.49
Aufwand			
Passivzinsen		-4.20	-30.53
Reglementarische Vergütungen		-217'757.64	-209'170.98
Sonstige Aufwendungen		-20'487.52	-84.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-581'657.99	-517'324.59
Total Aufwand		-819'907.35	-726'610.10
Nettoertrag / Verlust		7'340'934.79	5'186'308.39
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		26'480'395.03	-3'720'830.28
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		26'389.47	19'241.26
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		149'147.78	100'296.93
Realisierter Erfolg		33'996'867.07	1'585'016.30
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		55'782'179.07	169'667.63
Gesamterfolg		89'779'046.14	1'754'683.93

Verwendung des Erfolges

Klasse DA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	4'687.00	14'826.80
Vortrag des Vorjahres	94.51	227.57
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'781.51	15'054.37
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	4'779.23	14'959.86
Vortrag auf neue Rechnung	2.28	94.51
Total	4'781.51	15'054.37
Klasse DT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	30'288.82	26'460.78
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	30'288.82	26'460.78
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	10'601.09	9'261.27
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	19'687.73	17'199.51
Total	30'288.82	26'460.78
Klasse FA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	239'734.04	286'453.97
Vortrag des Vorjahres	2'089.98	3'504.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	241'824.02	289'958.49
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	238'482.02	287'868.51
Vortrag auf neue Rechnung	3'342.00	2'089.98
Total	241'824.02	289'958.49
Klasse GT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	20'489.54	28'704.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	20'489.54	28'704.39
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'171.34	10'046.54
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	13'318.20	18'657.85
Total	20'489.54	28'704.39
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	6'380'520.82	4'660'168.54
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'380'520.82	4'660'168.54
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'233'182.29	1'631'058.99
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'147'338.53	3'029'109.55
Total	6'380'520.82	4'660'168.54
Klasse NT USD	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	359'945.02	169'693.91
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	359'945.02	169'693.91
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	125'980.76	59'392.87
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	233'964.26	110'301.04
Total	359'945.02	169'693.91
Klasse NTH1 CHF	31.10.2024	
Nettoertrag	305'269.55	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	305'269.55	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	106'844.34	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	198'425.21	
Total	305'269.55	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							455'639'809.57	91.36	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							455'639'809.57	91.36	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	0	1'056	272	784 USD	2'037.18	1'381'054.84	0.28	a)
AR							1'381'054.84	0.28	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	5'059	0	0	5'059 EUR	51.74	245'722.58	0.05	a)
AT							245'722.58	0.05	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	38'424	16'175	8'399	46'200 AUD	61.52	1'609'774.57	0.32	a)
AU000000ANZ3	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	0	14'139	14'139	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000APA1	APA GROUP	55'922	0	55'922	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BxB1	BRAMBLES LTD	0	141'122	0	141'122 AUD	18.36	1'467'486.65	0.29	a)
AU000000COH5	COCHLEAR LTD	0	721	721	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000CPU5	COMPUTERSHARE LTD	0	85'837	47'436	38'401 AUD	26.38	573'751.83	0.12	a)
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	38'619	138'232	39'858	136'993 AUD	19.17	1'487'398.19	0.30	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	272'740	0	272'740	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	90'312	206'951	297'263	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000NST8	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	0	22'326	0	22'326 AUD	17.73	224'195.25	0.04	a)
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	100'207	70'505	24'477	146'235 AUD	17.21	1'425'407.23	0.29	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	757'022	37'581	719'441 AUD	3.51	1'430'240.46	0.29	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	13'085	17'582	30'667	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	0	450'407	450'407	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	285'469	122'511	256'816	151'164 AUD	4.69	401'539.23	0.08	a)
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	15'340	126'972	142'312	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU							8'619'793.41	1.73	
BE0003565737	KBC GROUP NV	12'090	6'909	18'999	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003739530	UCB SA	0	3'792	966	2'826 EUR	176.80	469'038.38	0.09	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	3'610	12'312	3'610	12'312 EUR	54.98	635'458.66	0.13	a)
BE0974464977	SYENQO SA	0	993	993	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE							1'104'497.04	0.22	
BMG0112X1056	AEGON LTD	97'077	137'126	234'203	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BM							0.00	0.00	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	16'597	79'860	96'457	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	11'380	0	11'380	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	0	14'448	14'448	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	65'126	65'126	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	0	40'266	0	40'266 CAD	71.69	1'790'669.07	0.36	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	21'665	21'665	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22'384	72'091	81'667	12'808 CAD	87.11	692'098.00	0.14	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	0	3'369	0	3'369 CAD	150.35	314'211.96	0.06	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	15'994	34'757	25'879	24'872 CAD	35.65	550'032.69	0.11	a)
CA2499061083	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	0	3'496	3'496	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA25675T1075	DOLLARAMA INC	0	5'246	633	4'613 CAD	144.89	414'610.34	0.08	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	0	21'941	21'941	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3495531079	FORTIS INC	0	18'269	18'269	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	3'869	5'192	9'061	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	0	10'487	10'487	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	0	25'852	25'852	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	14'065	23'110	27'665	9'510 CAD	113.44	669'213.97	0.13	a)
CA4932711001	KEYERA CORP	0	54'667	20'799	33'868 CAD	42.76	898'349.87	0.18	a)
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	146'088	98'802	47'286 CAD	14.05	412'123.30	0.08	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	14'606	8'575	6'031 CAD	176.04	658'595.79	0.13	a)
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	0	62'143	62'143	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	61'698	18'241	11'046	68'893 CAD	40.67	1'738'071.07	0.35	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	14'609	0	14'609	0 CAD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	55'077	9'751	64'828	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	7'648	21'095	28'743	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	22'306	0	22'306	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA70137W1086	PARKLAND CORP	9'209	6'196	15'405	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	38'048	38'048	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	15'441	48'085	8'705	54'821 CAD	44.01	1'496'637.37	0.30	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	5'276	2'979	8'255	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	0	7'178	7'178	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	18'664	18'664	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	69'502	36'516	32'986 CAD	77.20	1'579'665.80	0.32	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	13'556	45'279	13'556	45'279 CAD	52.56	1'476'285.81	0.30	a)
CA8849038085	THOMSON REUTERS CORP	0	4'889	3'275	1'614 CAD	227.91	228'183.99	0.05	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	25'616	30'621	27'581	28'656 CAD	76.97	1'368'218.06	0.27	a)
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	0	1'006	1'006	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA							14'286'967.09	2.86	
CH0102993182	TE CONNECTIVITY LTD	0	4'900	4'900	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0114405324	GARMIN LTD	659	3'790	659	3'790 USD	198.35	650'035.20	0.13	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	13'957	6'569	7'388 EUR	109.10	756'668.40	0.15	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	0	50'516	35'767	14'749 EUR	25.03	346'489.94	0.07	a)
CH							1'753'193.54	0.35	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	29'158	78'223	0	107'381 EUR	15.62	1'574'974.89	0.32	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	798	9'844	10'642	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	4'289	0	4'289 EUR	71.70	288'688.29	0.06	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	14'458	18'159	16'430	16'187 EUR	79.58	1'209'272.74	0.24	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	3'119	248	3'367	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	17'223	47'158	43'718	20'663 EUR	45.28	878'321.99	0.18	a)
DE0007164600	SAP SE	8'565	7'901	5'685	10'781 EUR	214.80	2'173'938.65	0.44	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	10'564	4'532	4'126	10'970 EUR	178.40	1'837'195.78	0.37	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	7'951	2'296	5'655 EUR	289.40	1'536'332.07	0.31	a)
DE000A1EWWWV0	ADIDAS AG	5'769	1'935	7'704	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	0	23'070	0	23'070 EUR	16.33	353'661.46	0.07	a)
DE000ENAG999	E.ON SE	65'203	15'284	80'487	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	0	10'019	4'263	5'756 EUR	75.60	408'504.21	0.08	a)
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	0	9'222	9'222	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE							10'260'890.08	2.06	
DK0010181759	CARLSBERG AS-B	0	832	832	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0010272202	GENMAB A/S	0	9'363	1'706	7'657 DKK	1'534.50	1'478'895.27	0.30	a)
DK0060252690	PANDORA A/S	8'249	3'781	2'124	9'906 DKK	1'034.00	1'289'231.01	0.26	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	14'578	13'454	28'032	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	13'634	9'690	11'849	11'475 DKK	763.10	1'102'163.51	0.22	a)
DK							3'870'289.79	0.78	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	9'427	14'880	11'864	12'443 EUR	66.60	777'952.88	0.16	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	42'639	5'908	48'547	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	0	186'581	0	186'581 EUR	4.49	786'794.15	0.16	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	4'422	8'442	12'864	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	0	143'893	65'937	77'956 EUR	13.65	998'566.63	0.20	a)
ES0144583301	IBERDROLA SA - ENT	0	4'111	4'111	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	21'191	2'600	23'791	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	94'421	49'307	45'114 EUR	17.00	719'969.70	0.14	a)
ES							3'283'283.36	0.66	
FI0009000681	NOKIA OYJ	0	56'441	0	56'441 EUR	4.33	229'157.87	0.05	a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	0	13'249	13'249	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009007884	ELISA OYJ	17'617	16'027	19'554	14'090 EUR	43.76	578'818.32	0.12	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	39'647	35'985	39'647	35'985 SEK	125.05	363'654.96	0.07	a)
FI							1'171'631.15	0.23	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	130'521	15'995	114'526 EUR	14.09	1'514'310.40	0.30	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	26'460	5'909	32'369	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120578	SANOFI	8'575	0	8'575	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	28'655	73'943	53'875	48'723 EUR	34.52	1'578'915.07	0.32	a)
FR0000120644	DANONE	18'990	10'717	2'762	26'945 EUR	65.70	1'661'871.80	0.33	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	416	380	796	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	4'126	4'126	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	0	5'489	4'088	1'401 EUR	215.40	283'294.27	0.06	a)
FR0000121964	KLEPIERRE	11'926	0	11'926	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	0	11'526	1'227	10'299 EUR	237.20	2'293'314.96	0.46	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	19'730	0	19'730	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	0	12'684	5'871	6'813 EUR	82.98	530'720.40	0.11	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	2'577	0	2'577	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	36'650	12'297	48'947	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	19'297	8'799	7'065	21'031 EUR	62.75	1'238'875.36	0.25	a)
FR0010208488	ENGIE	28'795	72'082	100'877	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010307819	LEGRAND SA	11'701	17'998	13'362	16'337 EUR	103.60	1'588'861.44	0.32	a)
FR0011981968	WORLDLINE SA	0	7'797	7'797	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	51'352	0	51'352	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0	3'702	0	3'702 EUR	74.88	260'229.31	0.05	a)
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	0	7'116	7'116	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	51'830	51'830	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	53'903	4'447	49'456 EUR	31.05	1'441'566.07	0.29	a)
FR							12'391'959.08	2.48	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	11'194	4'408	15'602	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	34'252	178'906	74'388	138'770 GBP	900.40	1'389'054.51	0.28	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	230'238	115'753	265'084	80'907 GBP	711.70	640'134.57	0.13	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	119'768	59'448	60'320 GBP	1'139.50	764'124.07	0.15	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	16'806	16'806	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007908733	SSE PLC	0	74'435	74'435	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	0	25'241	25'241	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	0	161'177	161'177	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	0	43'473	43'473	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	2'205	2'081	1'297	2'989 GBP	11'042.00	366'911.96	0.07	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	252'287	643'212	254'817	640'682 GBP	237.50	1'691'587.05	0.34	a)
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	0	19'383	804	18'579 GBP	4'648.00	960'012.02	0.19	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	46'557	51'031	97'588	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0033195214	KINGFISHER PLC	0	354'464	0	354'464 GBP	292.50	1'152'620.18	0.23	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	191'755	191'755	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B033F229	CENTRICA PLC	503'033	1'229'489	684'223	1'048'299 GBP	117.30	1'367'009.08	0.27	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	16'156	54'097	28'304	41'949 GBP	4'730.00	2'205'824.56	0.44	a)
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	0	6'458	6'458	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	34'895	13'618	48'513	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	0	10'920	0	10'920 GBP	4'684.00	568'627.34	0.11	a)
GB00B280DG97	RELX PLC	35'981	15'437	4'653	46'765 GBP	3'560.00	1'850'798.55	0.37	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	18'028	0	18'028	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	9'676	0	9'676	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4'896	6'037	3'486	7'447 USD	76.00	489'395.99	0.10	a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	0	16'970	16'970	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	1'027'294	0	1'027'294	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	87'994	87'994	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	306'956	281'354	346'631	241'679 GBP	342.20	919'405.58	0.18	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	285'946	285'946	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	127'505	127'505	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	15'757	29'402	31'452	13'707 GBP	1'392.50	212'190.45	0.04	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	65'587	91'051	109'442	47'196 GBP	2'578.50	1'352'883.95	0.27	a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	0	114'146	114'146	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BVVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	141'884	65'231	76'653 GBP	839.20	715'126.46	0.14	a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	167'061	66'466	100'595 GBP	601.50	672'667.19	0.13	a)
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	16'453	3'505	2'065	17'893 USD	99.12	1'533'592.28	0.31	a)
JE00BJN4441	CLARIVATE PLC	0	12'078	12'078	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	7'034	2'316	9'350	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB							18'851'965.79	3.78	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	37'400	289'800	327'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	149'000	111'000	260'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	0	256'000	256'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	22'500	22'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	0	37'000	37'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	280'000	280'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0823032773	LINK REIT	0	59'600	59'600	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	384'500	299'000	165'500	518'000 HKD	25.40	1'463'396.68	0.29	a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	0	136'500	136'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	362'800	362'800	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	350'000	70'000	280'000 HKD	23.30	725'625.51	0.15	a)
HK							2'189'022.19	0.44	
IE0001827041	CRH PLC	11'322	29'438	17'724	23'036 GBP	7'422.70	1'900'892.05	0.38	a)
IE0002424939	DCC PLC	0	1'912	1'912	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	0	6'226	1'429	4'797 EUR	91.50	412'045.12	0.08	a)
IE000IVNQZ81	TE CONNECTIVITY PLC	0	3'683	3'683	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	7'462	7'462	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	2'603	5'637	7'654	586 USD	344.82	174'725.19	0.04	a)
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	98'472	21'617	120'089	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	3'397	5'000	2'539	5'858 USD	370.16	1'875'013.13	0.38	a)
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	17'688	0	17'688	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE							4'362'675.49	0.87	
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	46'033	0	46'033	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006625771	BANK HAPOALIM BM	0	60'467	4'967	55'500 ILS	3'906.00	501'088.66	0.10	a)
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	1'242	589	1'831	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IL0011301780	WIX.COM LTD	0	3'409	1'350	2'059 USD	167.12	297'543.34	0.06	a)
IL							798'632.00	0.16	
IT0000062072	GENERALI	47'123	23'296	50'577	19'842 EUR	25.55	475'916.01	0.10	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	342'337	52'223	94'590	299'970 EUR	3.94	1'108'656.99	0.22	a)
IT0003128367	ENEL SPA	13'810	149'076	13'810	149'076 EUR	6.97	975'426.32	0.20	a)
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	35'812	19'079	0	54'891 EUR	12.94	666'790.46	0.13	a)
IT							3'226'789.78	0.65	
JP3111200006	ASAHI KASEI CORP	0	272'600	25'700	246'900 JPY	1'059.50	1'484'965.84	0.30	a)
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	26'700	7'400	34'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3118000003	ASICS CORP	0	114'000	85'400	28'600 JPY	2'714.00	440'626.17	0.09	a)
JP3137200006	ISUZU MOTORS LTD	0	8'300	8'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143600009	ITOCU CORP	16'400	0	16'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3160400002	EISAI CO LTD	0	31'400	0	31'400 JPY	5'178.00	922'966.86	0.19	a)
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	55'700	17'300	73'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	23'055	89'665	30'055	82'665 JPY	3'324.00	1'559'829.39	0.31	a)
JP3188220002	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	0	44'500	14'000	30'500 JPY	9'272.00	1'605'342.40	0.32	a)
JP3190000004	OBAYASHI CORP	0	10'300	10'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	0	27'900	27'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	53'288	15'200	68'488	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3201200007	OLYMPUS CORP	0	38'500	5'800	32'700 JPY	2'710.50	503'143.17	0.10	a)
JP3205800000	KAO CORP	0	4'300	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3228600007	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	0	117'300	22'300	95'000 JPY	2'455.00	1'323'943.69	0.27	a)
JP3242800005	CANON INC	0	55'400	0	55'400 JPY	5'004.00	1'573'698.31	0.32	a)
JP3294460005	INPEX CORP	0	138'400	8'700	129'700 JPY	2'013.50	1'482'470.37	0.30	a)
JP3300200007	KONAMI GROUP CORP	0	18'300	0	18'300 JPY	14'090.00	1'463'714.91	0.29	a)
JP3304200003	KOMATSU LTD	35'700	0	35'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3347200002	SHIONOGI & CO LTD	0	164'600	41'300	123'300 JPY	2'189.00	1'532'156.94	0.31	a)
JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	34'500	26'800	61'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3386450005	ENEOS HOLDINGS INC	0	658'700	319'600	339'100 JPY	776.40	1'494'540.64	0.30	a)
JP3407400005	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	0	53'400	53'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3409000001	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMEN	0	14'900	14'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3414750004	SEIKO EPSON CORP	0	64'600	64'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	67'900	9'900	77'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3436100006	SOFTBANK GROUP CORP	0	1'300	1'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3486800000	DAITO TRUST CONSTRUCT CO LTD	0	3'500	0	3'500 JPY	16'880.00	335'378.25	0.07	a)
JP3493800001	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	0	19'300	19'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	8'900	0	8'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3502200003	DAIWA SECURITIES GROUP INC	0	257'600	11'600	246'000 JPY	1'017.00	1'420'203.16	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP3519400000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	0	14'100	14'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	0	2'200	2'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	43'800	10'000	53'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3621000003	TORAY INDUSTRIES INC	0	34'700	0	34'700 JPY	836.20	164'715.34	0.03	a)
JP3629000005	TOPPAN HOLDINGS INC	0	23'600	23'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	11'900	50'600	62'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3637300009	TREND MICRO INC	0	18'100	18'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3639650005	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HO	36'800	0	36'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	15'200	86'700	34'400	67'500 JPY	2'558.50	980'355.54	0.20	a)
JP3732000009	SOFTBANK CORP	94'300	62'300	156'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762600009	NOMURA HOLDINGS INC	0	273'100	273'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	16'700	1'500	18'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3787000003	HITACHI CONSTRUCTION MACHINE	16'900	0	16'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	20'700	4'800	25'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3814800003	SUBARU CORP	0	33'600	33'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	0	36'800	36'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3837800006	HOYA CORP	0	14'100	14'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	108'600	37'200	145'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3866800000	PANASONIC HOLDINGS CORP	102'600	9'600	112'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3885780001	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	0	174'400	174'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3888300005	mitsui chemicals inc	2'800	0	2'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	0	85'100	3'800	81'300 JPY	3'439.00	1'587'146.93	0.32	a)
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	0	68'200	40'900	27'300 JPY	3'273.00	507'227.82	0.10	a)
JP3892100003	SUMITOMO MITSUI TRUST GROUP	24'700	89'400	114'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893200000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	32'900	175'800	208'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3897700005	MITSUBISHI CHEMICAL GROUP CO	27'600	235'800	27'600	235'800 JPY	830.80	1'112'076.60	0.22	a)
JP3899600005	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	0	148'800	148'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	0	133'000	133'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	28'300	64'900	35'200	58'000 JPY	5'568.00	1'833'249.75	0.37	a)
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	72'491	69'100	141'591	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942800008	YAMAHA MOTOR CO LTD	0	16'500	16'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	0	56'500	19'500	37'000 JPY	9'533.00	2'002'284.25	0.40	a)
JP							25'330'036.33	5.08	
KYG7800X1079	SANDS CHINA LTD	0	77'200	77'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
MO							0.00	0.00	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	304'016	103'281	407'297	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	8'586	4'289	1'352	11'523 EUR	154.70	1'673'438.81	0.34	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	6'527	3'333	804	9'056 USD	234.50	1'836'304.59	0.37	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	863	741	694	910 EUR	621.20	530'672.77	0.11	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	0	147'384	25'456	121'928 EUR	15.67	1'794'061.20	0.36	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	5'067	25'084	30'151	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015000IY2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	19'647	19'647	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							5'834'477.37	1.17	
NO0010063308	TELENOR ASA	0	19'394	19'394	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010096985	EQUINOR ASA	18'120	35'078	19'472	33'726 NOK	264.05	698'112.14	0.14	a)
NO0010161896	DNB BANK ASA	0	6'749	6'749	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	28'363	28'363	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO							698'112.14	0.14	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	7'163	119	7'282	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZMELE000257	MERIDIAN ENERGY LTD	0	43'513	43'513	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	0	81'537	0	81'537 NZD	2.91	122'106.73	0.02	a)
NZ							122'106.73	0.02	
PTEDPOAM0009	EDP SA	0	43'935	43'935	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	16'681	16'388	16'681	16'388 EUR	15.67	241'073.19	0.05	a)
PT							241'073.19	0.05	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	66'931	69'147	74'609	61'469 SEK	158.25	786'103.15	0.16	a)
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	0	25'436	0	25'436 SEK	201.30	413'782.64	0.08	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	51'837	14'766	66'603	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18'884	17'263	36'147	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000667925	TELIA CO AB	0	268'601	268'601	0 SEK	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	154'618	44'969	109'649 SEK	111.65	989'334.32	0.20	a)
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	50'417	50'417	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0012673267	EVOLUTION AB	0	22'705	3'325	19'380 SEK	1'005.00	1'573'981.07	0.32	a)
SE							3'763'201.18	0.75	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	16'036	57'024	73'060	0 USD	0.00	0.00	0.00	
SG1L01001701	DBS GROUP HOLDINGS LTD	0	60'500	2'000	58'500 SGD	38.66	1'478'278.15	0.30	a)
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	115'900	36'100	152'000	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG							1'478'278.15	0.30	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	42'268	19'461	22'807 USD	40.07	790'229.00	0.16	a)
BMG491BT1088	INVESCO LTD	61'905	9'124	71'029	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059YS762	LINDE PLC	1'093	273	960	406 USD	456.15	160'139.76	0.03	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	6'591	9'338	8'843	7'086 USD	331.58	2'031'678.26	0.41	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22'377	2'268	24'645	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	3'260	3'260	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	3'905	3'905	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	71'049	68'407	90'711	48'745 USD	22.54	950'056.53	0.19	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	526	3'277	3'803	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00287Y1091	ABBVIE INC	4'226	18'827	616	22'437 USD	203.87	3'955'337.71	0.79	a)
US00724F1012	ADOBE INC	4'388	4'578	2'203	6'763 USD	478.08	2'795'795.63	0.56	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	6'558	3'250	2'571	7'237 USD	144.07	901'566.13	0.18	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	1'933	1'933	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	5'547	0	5'547	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	14'373	6'888	21'261	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	57'188	31'788	3'240	85'736 USD	171.11	12'685'397.13	2.54	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	3'200	23'994	3'200	23'994 USD	54.46	1'129'914.94	0.23	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	57'513	28'793	4'054	82'252 USD	186.40	13'257'383.94	2.66	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	9'905	2'478	2'037	10'346 USD	270.08	2'416'185.97	0.48	a)
US02665T3068	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	0	56'355	25'574	30'781 USD	35.24	937'959.49	0.19	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	7'738	11'089	18'827	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03073E1055	CENCORA INC	5'712	5'298	11'010	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	0	3'080	3'080	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0311621009	AMGEN INC	5'273	4'282	623	8'932 USD	320.16	2'472'755.89	0.50	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35'064	0	35'064	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	2'815	0	2'815	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	2'250	7'872	4'437	5'685 USD	405.76	1'994'642.92	0.40	a)
US0378331005	APPLE INC	93'886	43'800	18'376	119'310 USD	225.91	23'306'537.62	4.67	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	3'903	13'272	1'686	15'489 USD	181.58	2'431'962.37	0.49	a)
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	14'242	14'242	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	775	12'832	6'301	7'306 USD	283.80	1'792'905.99	0.36	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	3'545	6'085	859	8'771 USD	289.24	2'193'678.22	0.44	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	0	197	197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	0	5'414	5'414	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	4'010	2'266	1'744 USD	423.50	638'653.58	0.13	a)
US05722G1004	BAKER HUGHES CO	0	11'987	11'987	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	12'762	9'138	4'728	17'172 USD	41.82	620'969.64	0.12	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26'558	6'912	5'776	27'694 USD	75.36	1'804'646.06	0.36	a)
US0865161014	BEST BUY CO INC	0	14'199	0	14'199 USD	90.43	1'110'288.26	0.22	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	4'350	132	4'482	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	529	196	88	637 USD	4'676.25	2'575'743.50	0.52	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	4'931	6'140	11'071	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BXP INC	0	18'734	15'122	3'612 USD	80.56	251'612.76	0.05	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27'954	25'509	6'894	46'569 USD	55.77	2'245'758.31	0.45	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	6'044	3'065	2'804	6'305 USD	210.86	1'149'594.70	0.23	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	2'764	47'034	6'101	43'697 USD	169.77	6'414'724.80	1.29	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0	6'433	6'433	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1'071	3'992	5'063	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0	18'915	7'726	11'189 USD	103.04	996'925.22	0.20	a)
US1255231003	THE CIGNA GROUP	0	9'169	1'828	7'341 USD	314.81	1'998'339.18	0.40	a)
US1264081035	CSX CORP	0	20'861	20'861	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1270971039	COTERRA ENERGY INC	37'835	76'940	40'151	74'624 USD	23.92	1'543'494.76	0.31	a)
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	5'445	783	6'228	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	24'303	35'530	59'833	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2'346	17'037	10'552	8'831 USD	162.79	1'243'091.41	0.25	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	11'250	19'137	21'975	8'412 USD	108.52	789'358.90	0.16	a)
US1423391002	CARLISLE COS INC	0	2'374	0	2'374 USD	422.23	866'752.82	0.17	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	4'463	5'341	1'715	8'089 USD	376.20	2'631'352.83	0.53	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	0	15'860	4'786	11'074 USD	62.26	596'182.32	0.12	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2'228	1'290	3'518	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	8'791	8'791	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	16'110	6'855	19'949	3'016 USD	148.82	388'112.92	0.08	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	520	38'034	17'237	21'317 USD	55.77	1'027'997.81	0.21	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	10'985	15'845	26'830	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	40'393	119'031	99'037	60'387 USD	54.77	2'859'905.31	0.57	a)
US1729081059	CINTAS CORP	165	12'572	4'480	8'257 USD	205.81	1'469'447.98	0.29	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	0	40'118	14'202	25'916 USD	64.17	1'438'021.80	0.29	a)
US1746101054	CITIZENS FINANCIAL GROUP	0	4'055	0	4'055 USD	42.12	147'687.82	0.03	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	8'918	8'918	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	8'017	61'009	15'011	54'015 USD	65.31	3'050'419.18	0.61	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	1'912	1'912	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	0	22'021	3'575	18'446 USD	93.71	1'494'698.51	0.30	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	44'554	17'317	61'871	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	0	3'445	3'445	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	14'732	3'223	17'955	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	12'012	6'574	9'404	9'182 USD	101.68	807'306.19	0.16	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	0	46'685	13'873	32'812 USD	60.92	1'728'454.92	0.35	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	984	834	98	1'720 USD	874.18	1'300'153.93	0.26	a)
US22788C1053	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	0	1'132	1'132	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	11'552	24'347	17'734	18'165 USD	107.49	1'688'375.04	0.34	a)
US2310211063	CUMMINS INC	0	6'406	435	5'971 USD	328.98	1'698'564.43	0.34	a)
US2358511028	DANAHER CORP	356	0	356	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	0	1'468	1'468	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23918K1088	DAVITA INC	0	11'555	4'624	6'931 USD	139.81	837'914.28	0.17	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	1'694	11'621	6'000	7'315 USD	160.89	1'017'674.38	0.20	a)
US2441991054	DEERE & CO	0	3'781	1'155	2'626 USD	404.69	918'930.47	0.18	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	5'479	0	5'479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	79'293	43'858	35'435 USD	38.68	1'185'180.13	0.24	a)
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	1'882	15'439	17'321	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2533931026	DICK'S SPORTING GOODS INC	0	7'882	0	7'882 USD	195.75	1'334'146.93	0.27	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	0	1'058	1'058	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12'472	4'725	17'197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	26'062	19'255	6'807 USD	69.38	408'371.58	0.08	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	406	406	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25809K1051	DOORDASH INC - A	0	8'549	7'102	1'447 USD	156.70	196'066.32	0.04	a)
US2600031080	DOVER CORP	0	9'778	9'778	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2605571031	DOW INC	23'114	3'634	26'748	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	13'230	3'752	16'982	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26441C2044	DUKE ENERGY CORP	0	6'159	6'159	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	0	27'282	5'198	22'084 USD	82.99	1'584'779.93	0.32	a)
US2681501092	DYNATRACE INC	0	5'202	5'202	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	15'757	23'209	9'885	29'081 USD	57.51	1'446'166.05	0.29	a)
US2788651006	ECOLAB INC	6'600	8'983	7'255	8'328 USD	245.73	1'769'556.18	0.35	a)
US2810201077	EDISON INTERNATIONAL	0	23'757	2'329	21'428 USD	82.40	1'526'772.43	0.31	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16'263	23'738	22'789	17'212 USD	67.01	997'324.33	0.20	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	0	16'553	3'276	13'277 USD	150.85	1'731'851.81	0.35	a)
US29084Q1004	EMCOR GROUP INC	0	3'977	0	3'977 USD	446.07	1'533'995.43	0.31	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	12'647	27'698	40'345	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	2'355	2'355	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29444U7000	EQUINIX INC	0	3'613	1'665	1'948 USD	908.08	1'529'602.28	0.31	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	2'689	44'702	9'686	37'705 USD	45.34	1'478'243.30	0.30	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	15'884	0	15'884	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	15'399	57'510	45'626	27'283 USD	65.85	1'553'507.53	0.31	a)
US30063P1057	EXACT SCIENCES CORP	0	9'736	9'736	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US30161N1019	EXELON CORP	0	47'897	0	47'897 USD	39.30	1'627'669.86	0.33	a)
US30212P3038	EXPEDIA GROUP INC	0	5'802	5'802	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	0	6'855	3'097	3'758 USD	119.00	386'695.57	0.08	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	15'101	20'864	14'043	21'922 USD	116.78	2'213'676.24	0.44	a)
US3024913036	FMC CORP	2'032	19'441	21'473	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	9'810	7'956	390	17'376 USD	567.58	8'527'904.94	1.71	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	3'709	3'656	7'365	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US31488V1070	FERGUSON ENTERPRISES INC	0	8'824	8'824	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3156161024	F5 INC	0	7'822	185	7'637 USD	233.88	1'544'476.61	0.31	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	21'666	33'272	32'489	22'449 USD	89.73	1'741'807.38	0.35	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	16'742	0	16'742	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	0	3'735	3'735	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	0	4'282	4'282	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	14'371	32'225	22'435	24'161 USD	71.43	1'492'316.75	0.30	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	0	27'463	7'928	19'535 USD	83.33	1'407'603.24	0.28	a)
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	7'282	7'282	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	4'674	72'599	33'286	43'987 USD	38.96	1'481'865.37	0.30	a)
US3666511072	GARTNER INC	0	2'600	1'937	663 USD	502.50	288'081.29	0.06	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC	0	11'585	11'585	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	17'210	13'197	2'594	27'813 USD	68.02	1'635'874.27	0.33	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	5'986	783	6'769	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	18'637	12'741	2'865	28'513 USD	88.82	2'189'874.07	0.44	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	0	5'995	363	5'632 USD	517.79	2'521'632.33	0.51	a)
US3847471014	GRAIL INC	0	1'761	1'761	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	VW GRAINGER INC	1'150	2'525	3'675	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	3'683	1'719	3'683	1'719 USD	358.74	533'238.06	0.11	a)
US40434L1052	HP INC	0	42'451	0	42'451 USD	35.52	1'303'846.13	0.26	a)
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	30'138	18'329	11'809 USD	110.44	1'127'729.60	0.23	a)
US4180561072	HASBRO INC	0	32'205	32'205	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42250P1030	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0	43'238	0	43'238 USD	22.45	839'358.32	0.17	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	0	4'110	4'110	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	0	78'323	0	78'323 USD	19.49	1'319'977.75	0.26	a)
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0	10'155	1'383	8'772 USD	234.85	1'781'372.10	0.36	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	15'298	21'379	15'298	21'379 USD	80.87	1'494'996.89	0.30	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	2'716	15'570	6'451	11'835 USD	393.75	4'029'529.02	0.81	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	12'548	81'616	94'164	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4435106079	HUBBELL INC	2'741	998	1'613	2'126 USD	427.03	785'031.54	0.16	a)
US4448591028	HUMANA INC	0	7'978	4'216	3'762 USD	257.83	838'721.35	0.17	a)
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	101'395	6'363	107'758	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	0	19'919	19'919	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45337C1027	INCYTE CORP	17'517	20'884	19'860	18'541 USD	74.12	1'188'321.69	0.24	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	17'228	17'228	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45784P1012	INSULET CORP	0	2'610	2'610	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	11'367	45'977	57'344	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	9'490	6'798	1'884	14'404 USD	206.72	2'574'726.29	0.52	a)
US4595061015	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	0	2'886	0	2'886 USD	99.43	248'129.97	0.05	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	28'787	23'876	52'663	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4612021034	INTUIT INC	3'384	1'676	280	4'780 USD	610.30	2'522'532.24	0.51	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	0	996	996	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	16'747	19'707	34'830	1'624 USD	123.73	173'750.67	0.03	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	16'523	4'801	5'934	15'390 USD	221.92	2'953'252.11	0.59	a)
US46982L1089	JACOBS SOLUTIONS INC	0	4'038	4'038	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	19'854	10'206	1'201	28'859 USD	159.86	3'989'206.76	0.80	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	9'350	42'709	25'103	26'956 USD	38.90	906'714.39	0.18	a)
US4824801009	KLA CORP	0	289	289	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4878361082	KELLANOVA	16'513	19'857	36'370	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49177J1025	KENVUE INC	0	25'786	25'786	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	35'587	8'012	43'599	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	60'397	60'397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8'368	3'702	12'070	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	9'392	5'447	440	14'399 USD	134.18	1'670'650.40	0.33	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	13'221	0	13'221	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	0	238'280	157'287	80'993 USD	24.51	1'716'549.20	0.34	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	93'281	40'697	52'584 USD	33.46	1'521'405.62	0.31	a)
US5010441013	KROGER CO	0	34'214	26'588	7'626 USD	55.77	367'758.66	0.07	a)
US5018892084	LKQ CORP	20'393	4'873	25'266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	7'695	7'695	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	2'346	1'168	3'514	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5128073062	LAM RESEARCH CORP	0	30'580	0	30'580 USD	74.35	1'966'001.81	0.39	a)
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	0	27'000	27'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5218652049	LEAR CORP	0	1'708	1'708	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	5'837	2'432	2'158	6'111 USD	829.74	4'384'496.92	0.88	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	4'367	3'818	8'185	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5494981039	LUCID GROUP INC	37'712	190'651	228'363	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5627501092	MANHATTAN ASSOCIATES INC	0	5'558	1'893	3'665 USD	263.36	834'620.89	0.17	a)
US5658491064	MARATHON OIL CORP	25'344	55'699	15'595	65'448 USD	27.70	1'567'622.93	0.31	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	8'501	8'287	16'788	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	7'193	1'522	5'336	3'379 USD	499.59	1'459'712.70	0.29	a)
US57667L1070	MATCH GROUP INC	0	6'610	0	6'610 USD	36.03	205'935.48	0.04	a)
US5797802064	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	0	20'980	11'409	9'571 USD	78.24	647'517.66	0.13	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	852	2'567	852	2'567 USD	292.11	648'392.16	0.13	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	0	2'508	2'508	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	23'470	14'624	3'024	35'070 USD	102.32	3'102'856.97	0.62	a)
US59156R1086	METLIFE INC	0	26'675	2'461	24'214 USD	78.42	1'641'945.87	0.33	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	43'638	17'466	4'715	56'389 USD	406.35	19'813'450.58	3.97	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1'506	0	1'506	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0	11'043	6'771	4'272 USD	151.34	559'049.72	0.11	a)
US60770K1079	MODERNA INC	0	7'882	0	7'882 USD	54.36	370'494.14	0.07	a)
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE INC	0	1'065	1'065	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16'352	12'180	28'532	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	0	18'128	18'128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6153691059	MOODY'S CORP	0	562	562	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6174464486	MORGAN STANLEY	19'763	1'082	20'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	0	3'234	3'234	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6200763075	MOTOROLA SOLUTIONS INC	0	2'875	2'875	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6311031081	NASDAQ INC	0	10'085	0	10'085 USD	73.92	644'619.32	0.13	a)
US64110D1046	NETAPP INC	2'368	13'841	1'041	15'168 USD	115.31	1'512'379.39	0.30	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	424	4'637	1'349	3'712 USD	756.03	2'426'679.69	0.49	a)
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	3'128	3'128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6516391066	NEWMONT CORP	0	2'549	0	2'549 USD	45.44	100'155.23	0.02	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	26'204	14'574	26'204	14'574 USD	27.25	343'408.26	0.07	a)
US65473P1057	NISOURCE INC	0	25'955	0	25'955 USD	35.16	789'106.02	0.16	a)
US6687711084	GEN DIGITAL INC	0	28'397	0	28'397 USD	29.11	714'792.73	0.14	a)
US6703461052	NUCOR CORP	5'144	19'779	15'588	9'335 USD	141.84	1'144'928.86	0.23	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	16'530	210'223	25'182	201'571 USD	132.76	23'139'861.39	4.64	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	449	0	449	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	0	35'816	35'816	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	1'608	173	1'781	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6826801036	ONEOK INC	0	37'630	16'381	21'249 USD	96.88	1'780'074.12	0.36	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	4'572	12'062	12'837	3'797 USD	167.84	551'063.35	0.11	a)
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	2'236	0	2'236	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	55'836	55'836	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	6'696	1'384	8'080	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3'727	7'935	6'170	5'492 USD	188.27	894'081.50	0.18	a)
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	8'691	6'430	15'121	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69370C1009	PTC INC	0	9'953	9'953	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	992	254	1'246	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	3'240	11'436	12'808	1'868 USD	360.33	582'026.49	0.12	a)
US7043261079	PAYCHEX INC	0	10'988	7'611	3'377 USD	139.33	406'856.40	0.08	a)
US70432V1026	PAYCOM SOFTWARE INC	0	10'114	0	10'114 USD	209.03	1'828'087.71	0.37	a)
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	5'371	0	5'371	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	2'802	466	1'753	1'515 USD	166.08	217'568.20	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US7170811035	PFIZER INC	46'649	4'417	51'066	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	2'699	5'937	8'636	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	19'613	22'562	17'955	24'220 USD	165.18	3'459'370.36	0.69	a)
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	0	9'066	0	9'066 USD	242.83	1'903'634.27	0.38	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12'211	4'172	750	15'633 USD	122.48	1'655'666.89	0.33	a)
US7445731067	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	0	13'236	13'236	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7458671010	PULTEGROUP INC	14'475	942	15'417	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74736K1016	QORVO INC	0	15'581	15'581	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7475251036	QUALCOMM INC	9'554	10'221	1'732	18'043 USD	162.77	2'539'502.07	0.51	a)
US74762E1029	QUANTA SERVICES INC	0	2'189	2'189	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	8'026	19'476	26'137	1'365 USD	154.83	182'748.25	0.04	a)
US7496851038	RPM INTERNATIONAL INC	0	4'084	4'084	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	1'748	659	787	1'620 USD	838.20	1'174'162.29	0.24	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	7'230	71'396	17'262	61'364 USD	23.87	1'266'576.83	0.25	a)
US7595091023	RELIANCE INC	423	0	423	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7611521078	RESMED INC	0	1'095	429	666 USD	242.47	139'636.10	0.03	a)
US76954A1034	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	0	51'549	21'154	30'395 USD	10.10	265'453.82	0.05	a)
US7703231032	ROBERT HALF INC	7'149	16'791	23'940	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	0	3'559	749	2'810 USD	480.36	1'167'182.09	0.23	a)
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	0	3'987	3'987	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	10'003	4'268	1'044	13'227 USD	291.37	3'332'511.42	0.67	a)
US8064071025	HENRY SCHEIN INC	1'862	0	1'862	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81762P1021	SERVICENOW INC	2'863	2'633	2'121	3'375 USD	932.99	2'722'803.03	0.55	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	6'731	4'027	2'704 USD	358.77	838'857.64	0.17	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	5'327	4'823	10'150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	0	79'361	79'361	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	8'739	5'871	14'610	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8330341012	SNAP-ON INC	3'684	733	4'417	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US83444M1018	SOLVENTUM CORP	0	3'798	3'798	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8552441094	STARBUCKS CORP	0	7'436	7'436	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8574771031	STATE STREET CORP	14'739	6'883	1'473	20'149 USD	92.80	1'616'839.58	0.32	a)
US8636671013	STRYKER CORP	0	1'931	288	1'643 USD	356.28	506'167.74	0.10	a)
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'907	3'642	6'549	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	29'748	11'010	8'582	32'176 USD	55.14	1'534'137.46	0.31	a)
US8718291078	SYSCO CORP	16'505	13'217	29'722	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	9'085	3'241	5'844 USD	223.16	1'127'695.95	0.23	a)
US87612E1064	TARGET CORP	0	4'839	0	4'839 USD	150.04	627'809.87	0.13	a)
US88160R1014	TESLA INC	15'121	7'383	2'491	20'013 USD	249.85	4'323'714.49	0.87	a)
US88262P1021	TEXAS PACIFIC LAND CORP	0	212	212	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	168	604	528	244 USD	546.32	115'266.31	0.02	a)
US88579Y1010	3M CO	13'421	7'285	4'052	16'654 USD	128.47	1'850'059.70	0.37	a)
US8962391004	TRIMBLE INC	0	28'208	28'208	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	0	55'160	40'004	15'156 USD	43.05	564'187.18	0.11	a)
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	29'561	5'520	35'081	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	17'872	17'872	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	0	2'345	2'345	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	8'718	8'718	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113631090	UNITED RENTALS INC	2'394	661	620	2'435 USD	812.80	1'711'386.57	0.34	a)
US91307C1027	UNITED THERAPEUTICS CORP	0	677	0	677 USD	373.97	218'922.75	0.04	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	3'697	11'371	10'659	4'409 USD	564.50	2'152'134.97	0.43	a)
US9182041080	VF CORP	17'289	19'359	36'648	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	4'460	787	5'247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	3'971	8'226	12'197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	0	7'936	7'936	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92338C1036	VERALTO CORP	6'071	18'997	8'742	16'326 USD	102.19	1'442'625.65	0.29	a)
US92343E1029	VERISIGN INC	0	7'028	7'028	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3'282	74'418	5'517	72'183 USD	42.13	2'629'613.05	0.53	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	4'911	499	5'410	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3'969	3'404	4'200	3'173 USD	475.98	1'305'943.04	0.26	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	8'898	5'220	3'678 USD	109.29	347'582.27	0.07	a)
US9256521090	VICI PROPERTIES INC	0	38'106	0	38'106 USD	31.76	1'046'500.20	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	13'263	3'720	10'235	6'748 USD	289.85	1'691'273.47	0.34	a)
US9297401088	WABTEC CORP	0	10'323	8'468	1'855 USD	187.98	301'523.40	0.06	a)
US9311421039	WALMART INC	4'851	15'051	5'325	14'577 USD	81.95	1'032'957.78	0.21	a)
US9497461015	WELLS FARGO & CO	0	6'703	4'186	2'517 USD	64.92	141'295.13	0.03	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	0	2'291	2'291	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	17'936	5'359	12'577 USD	134.13	1'458'708.27	0.29	a)
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	5'423	4'377	9'800	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98419M1009	XYLEM INC	11'529	14'041	11'998	13'572 USD	121.78	1'429'174.57	0.29	a)
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	15'750	0	15'750	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9'783	15'541	9'147	16'177 USD	106.92	1'495'623.89	0.30	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	0	2'405	2'405	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	19'116	14'610	33'726	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	0	1'616	1'616	0 USD	0.00	0.00	0.00	

US **330'374'157.27** **66.25**

Bezugsrechte **0.00** **0.00**

DE00LEG1268	LEG IMMOBILIEN SE-SCRIP	0	4'008	4'008	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0644580957	IBERDROLA SA-RTS	0	139'782	139'782	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	65'587	65'587	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	17'030	17'030	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9Z14	SHELL PLC - EEE JUN24	0	56'233	56'233	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1WB003	SHELL PLC - EEE SEPT24	0	90'624	90'624	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BSRK4Y08	NATIONAL GRID PLC-NIL	0	50	50	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001Z20	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	8'858	8'858	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150024P3	AEGON LTD-DRIP	0	179'865	179'865	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150026X2	WOLTERS KLUWER NV -DRIP	0	10'326	10'326	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

Diverse **0.00** **0.00**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen **0.00** **0.00**

IE00BF4G7076	JPM US REI ESG UCITS ETF	104'417	0	104'417	0 USD	0.00	0.00	0.00	
--------------	--------------------------	---------	---	---------	-------	------	------	------	--

GB **0.00** **0.00**

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

14'679'410.53 **2.94**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen **14'679'410.53** **2.94**

LU1900091650	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE USA NT	51'965	0	0	51'965 USD	221.58	9'956'481.16	2.00	a)
LU1900092039	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE EUROZONE NT	17'626	0	0	17'626 EUR	171.86	2'843'663.72	0.57	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	15'080	0	0	15'080 CHF	124.62	1'879'265.65	0.38	a)

LU **14'679'410.53** **2.94**

Derivative Finanzinstrumente **0.00** **0.00**

Futures **0.00** **0.00**

12/23	NIKKEI 225 (SGX) DEC23	2	8	10	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	1	32	33	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	3	55	58	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	8	8	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	0	3	3	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	1	2	3	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NIKKEI 225 (SGX) MAR24	0	28	28	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	49	49	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	93	93	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	11	11	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	5	5	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	3	3	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/24	NIKKEI 225 (SGX) JUN24	0	20	20	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/24	SPI 200 FUTURES JUN24	0	6	6	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	125	125	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	173	173	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	25	25	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/24	S&P/TSX 60 IX FUT JUN24	0	10	10	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/24	NIKKEI 225 (SGX) SEP24	0	42	42	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/24	SPI 200 FUTURES SEP24	0	10	10	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO STOXX 50 SEP24	0	107	107	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	S&P500 EMINI FUT SEP24	0	160	160	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	FTSE 100 IDX FUT SEP24	0	23	23	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/24	S&P/TSX 60 IX FUT SEP24	0	8	8	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/24	NIKKEI 225 (SGX) DEC24	0	15	4	11 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	SPI 200 FUTURES DEC24	0	4	0	4 AUD	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	EURO STOXX 50 DEC24	0	63	11	52 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	S&P500 EMINI FUT DEC24	0	109	23	86 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	FTSE 100 IDX FUT DEC24	0	13	2	11 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	S&P/TSX 60 IX FUT DEC24	0	6	1	5 CAD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

CAD/USD	Verfall	22.11.2023	42'000	57'670	USD/CAD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	22.12.2023	338'000	253'752	CAD/USD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall	26.01.2024	256'000	189'871	CAD/USD	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF	Verfall	03.06.2024	281'514	423'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.06.2024	6'694'222	7'325'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.06.2024	329'149	364'000	CHF/USD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	03.06.2024	19'188	29'000	CHF/CAD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	03.06.2024	581'301	877'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.06.2024	13'419'547	14'838'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall	03.06.2024	41'000	27'333	CAD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.06.2024	219'599	243'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	03.06.2024	47'260	8'189'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	03.06.2024	28'778	25'000	CHF/GBP	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.06.2024	351'331	307'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.06.2024	168'680	284'000	CHF/AUD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.06.2024	582'557	99'855'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.06.2024	881'500	901'000	CHF/EUR	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall	04.06.2024	30'197	45'000	CHF/SGD	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.06.2024	87'519	667'000	CHF/DKK	0.00	0.00
HKD/CHF	Verfall	04.06.2024	43'155	369'000	CHF/HKD	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall	04.06.2024	15'277	185'000	CHF/NOK	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.06.2024	72'537	870'000	CHF/SEK	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.06.2024	23'735	4'081'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.06.2024	22'720	20'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.06.2024	56'702	58'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	04.06.2024	345'815	577'000	CHF/AUD	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall	04.06.2024	65'607	98'000	CHF/SGD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	04.06.2024	721'746	634'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.06.2024	1'800'496	1'838'000	CHF/EUR	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	04.06.2024	150'730	1'802'000	CHF/SEK	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall	04.06.2024	29'703	355'000	CHF/NOK	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	04.06.2024	185'936	1'416'000	CHF/DKK	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	04.06.2024	1'162'142	200'410'000	CHF/JPY	0.00	0.00
HKD/CHF	Verfall	04.06.2024	84'790	732'000	CHF/HKD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall	04.06.2024	40'000	3'429	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall	04.06.2024	73'000	9'674	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	04.06.2024	8'000	5'408	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall	04.06.2024	2'010'000	263'893	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.06.2024	22'770'000	20'540'817	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	04.06.2024	135'000	90'098	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/HKD	Verfall	04.06.2024	1'101'000	126'955	HKD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	04.06.2024	312'535'000	1'794'138	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall	04.06.2024	1'288'000	852'373	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall	04.06.2024	500'000	42'950	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall	04.06.2024	861'000	516'548	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.06.2024	2'797'000	2'739'102	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall	04.06.2024	2'672'000	229'177	SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	04.06.2024	986'000	1'132'460	GBP/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	01.07.2024	21'637'474	24'063'000	CHF/USD	0.00	0.00
HKD/CHF	Verfall	01.07.2024	138'031	1'200'000	CHF/HKD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	01.07.2024	890'961	1'350'000	CHF/CAD	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		733'504	825'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		428'575	481'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		254'679	284'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		281'801	2'150'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		93'257	140'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		1'838'944	320'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		44'554	520'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		538'651	900'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		2'736'602	2'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		248'272	2'900'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		1'173'656	1'025'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		103'000	8'822		SEK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		155'914	164'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		36'034	32'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		91'545	16'232'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		15'773	191'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.07.2024		32'963	51'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		22'333	38'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		15'816	14'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.07.2024		12'434	109'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		50'627	53'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		16'391	128'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		33'911	5'998'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		49'814	52'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.07.2024		26'193	40'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		29'822	50'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.07.2024		988'000	592'899		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		1'441'000	946'362		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		2'988'000	253'502		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.07.2024		520'000	43'883		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.07.2024		140'000	92'823		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.07.2024		342'230'000	1'911'868		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		1'071'000	1'216'667		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.07.2024		2'278'000	294'158		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		25'653'000	23'053'607		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		3'069'000	2'955'754		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.07.2024		1'309'000	150'684		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2024		916'640	1'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		23'811'735	26'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		102'965	115'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		236'351	264'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		461'965	520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		409'176	459'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2024		393'000	346'928		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.08.2024		1'400'000	892'346		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2024		27'565'000	24'271'589		USD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		253'897	3'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.08.2024		45'422	540'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		95'233	144'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		1'858'706	332'364'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		1'188'173	1'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		319'543	2'480'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		2'725'429	2'837'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.08.2024		139'885	1'219'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		87'300	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		50'244	9'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		47'706	8'570'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		81'404	84'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		55'131	57'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		74'118	13'070'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		23'207	24'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		15'747	2'752'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		33'000	31'623		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		14'086'000	81'034		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.08.2024		540'000	43'470		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.08.2024		2'480'000	316'597		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		351'670'000	2'057'516		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		3'059'000	2'914'003		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		1'050'000	1'187'120		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.08.2024		3'000'000	246'360		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 05.08.2024		1'219'000	137'350		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.08.2024		144'000	94'759		SGD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		598'118	1'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.08.2024		1'000'000	574'770		AUD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	ILS/CHF Verfall 03.09.2024		29'902	128'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		44'152	550'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		1'022'537	1'609'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		312'184	2'450'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		2'013'677	343'895'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		619'129	1'080'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		2'816'580	2'963'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		1'296'040	1'150'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		274'042	3'344'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		24'352'998	27'764'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		143'617	1'278'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		101'785	155'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.09.2024		66'000	7'195		HKD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		559'219	664'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		147'690	157'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		101'309	17'339'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.09.2024		22'000	1'777		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.09.2024		145'000	12'010		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.09.2024		45'000	50'250		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.09.2024		55'000	34'647		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.09.2024		13'000	7'493		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.09.2024		9'402'000	54'879		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.09.2024		706'000	599'105		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.09.2024		73'000	68'580		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.09.2024		2'450'000	308'455		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.09.2024		351'832'000	2'050'266		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.09.2024		1'554'000	978'243		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.09.2024		1'067'000	614'208		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.09.2024		3'047'000	2'861'438		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.09.2024		1'212'000	131'823		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.09.2024		1'105'000	1'232'119		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.09.2024		27'722'000	23'519'622		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.09.2024		128'000	29'937		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.09.2024		528'000	42'293		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.09.2024		155'000	100'894		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.09.2024		3'199'000	265'005		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.10.2024		1'036'174	1'650'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.10.2024		24'771'735	29'295'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.10.2024		227'004	269'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.10.2024		139'825	165'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.10.2024		21'000	13'210		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.10.2024		410'000	347'470		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.10.2024		29'319'000	24'733'831		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.10.2024		1'629'000	1'017'221		CAD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		320'471	2'550'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		2'012'494	345'079'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		631'486	1'100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		2'908'830	3'104'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.10.2024		146'511	1'350'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		1'278'257	1'150'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.10.2024		32'660	140'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		43'133	540'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		101'369	156'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		268'713	3'250'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.10.2024		26'000	2'073		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.10.2024		24'000	1'867		NOK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		176'569	188'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		70'894	11'777'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		24'528	26'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		10'532	130'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		118'000	111'670		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		20'000	22'701		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		5'693'000	33'330		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		3'200'000	3'012'800		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.10.2024		620'000	49'656		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.10.2024		1'350'000	146'636		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		1'130'000	1'278'663		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.10.2024		2'550'000	322'065		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.10.2024		3'250'000	270'498		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.10.2024		140'000	31'749		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		351'163'000	2'071'019		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.10.2024		156'000	102'642		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.10.2024		1'100'000	643'698		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.11.2024		25'328'748	30'132'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 01.11.2024		1'027'389	1'650'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.11.2024		30'132'000	26'062'704		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.11.2024		1'650'000	1'023'719		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		2'988'592	3'182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.11.2024		49'324	618'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.11.2024		162'357	1'500'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		1'239'995	1'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.11.2024		289'885	2'300'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		265'744	3'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.11.2024		32'326	143'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.11.2024		105'702	161'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		664'914	1'140'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.11.2024		77'000	9'675		DKK/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		31'120	380'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.11.2024		36'000	20'696		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.11.2024		1'100'000	1'222'870		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.11.2024		2'223'000	279'787		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.11.2024		161'000	105'236		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.11.2024		3'182'000	2'987'262		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.11.2024		3'580'000	289'336		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.11.2024		143'000	33'053		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.11.2024		1'104'000	625'317		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.11.2024		618'000	48'439		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.11.2024		1'500'000	166'845		HKD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		2'064'879	349'874'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.11.2024		349'874'000	1'986'235		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2024		26'234'443	30'434'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 02.12.2024		1'052'135	1'700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.12.2024		1'218'965	1'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 03.12.2024		285'840	2'275'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.12.2024		105'689	162'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.12.2024		2'857'676	3'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.12.2024		1'957'833	344'684'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 03.12.2024		279'953	3'470'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 03.12.2024		34'126	148'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.12.2024		621'273	1'100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 03.12.2024		50'715	649'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 03.12.2024		155'316	1'400'000		CHF/HKD	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	22'616'828.14	4.54
Bankguthaben auf Zeit	5'188'200.00	1.04
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	455'639'809.57	91.36
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	14'679'410.53	2.94
Sonstige Vermögenswerte	586'380.19	0.12
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	498'710'628.43	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-5'692'017.13	
Andere Verbindlichkeiten	-140'065.57	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	492'878'545.73	

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);	470'319'220.10	94.31
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
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)
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	13'113'993.28	2.63
US02079K3059 ALPHABET INC-CL A	5'346 USD	171.11
US11135F1012 BROADCOM INC	43'697 USD	169.77
US2855121099 ELECTRONIC ARTS INC	13'277 USD	150.85
US5324571083 ELI LILLY & CO	5'821 USD	829.74

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
HKD	100 = CHF	11.12240200
ILS	1 = CHF	0.23114758
JPY	100 = CHF	0.56766800
NOK	100 = CHF	7.83924400
NZD	1 = CHF	0.51462621
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
USD	1 = CHF	0.86470000

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	886'944.30	5.682
Bond	CHF	14'723'375.35	94.318
Total	CHF	15'610'319.65	100.000

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	27'141'289.53	5.507
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	34'950'049.93	7.091

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
FA CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NT USD	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	13'113'993.28
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DA CHF	0.500	0.700	0.450	0.050	2.000
DT CHF	0.500	0.700	0.450	0.050	2.000
FA CHF	0.700	0.900	0.600	0.100	2.000
GT CHF	0.400	0.600	0.350	0.050	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NT USD	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

MSCI World ex Switzerland Index TR Net

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DA CHF	Ja	CHF	1.60000	0.56000	1.04000
FA CHF	Ja	CHF	1.60000	0.56000	1.04000

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	2.188	0.765	1.423
GT CHF	Ja	CHF	2.175	0.761	1.414
NT CHF	Ja	CHF	47.866	16.753	31.113
NT USD	Ja	CHF	1.920	0.672	1.248
NTH1 CHF	Ja	CHF	0.97272	0.34045	0.63227

Sonderausschüttung 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Sonderausschüttung der ausländischen Quellensteuer

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	CHF	0.6500	0.2275	0.4225

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

12 Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Übersicht

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022	01.11.2020 31.10.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		701'318'743.20	434'641'918.34	426'224'273.75	474'273'978.99
Klasse AA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'698'485.12	2'350'603.70	1'972'143.13	2'134'759.54
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		21'675.483	21'344.056	16'499.788	15'763.583
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		124.4948	110.1292	119.5254	135.4235
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		124.4201	110.1953	119.4417	135.3152
Ausschüttung je Anteil		1.10	0.95	1.35	1.20
Total Expense Ratio (TER)		1.50 %	1.50 %	1.50 %	1.50 %
Klasse BA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		138'811.88	122'821.99	164'505.59	181'879.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'160.000	1'160.000	1'433.000	1'397.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		119.6654	105.8810	114.7980	130.1927
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		119.5936	105.9446	114.7177	130.0885
Ausschüttung je Anteil		1.75	1.60	1.85	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.93 %	0.93 %	0.93 %	0.93 %
Klasse CT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'863'787.86	9'524'900.17	11'701'049.38	18'055'687.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		73'684.809	90'373.302	103'547.033	142'506.522
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		120.2933	105.3951	113.0023	126.7008
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		120.2211	105.4583	112.9232	126.5994
Thesaurierung je Anteil		1.89	1.77	1.96	2.04
Total Expense Ratio (TER)		0.79 %	0.79 %	0.79 %	0.79 %
Klasse DA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode				54'172.03	95'757.99
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				446.981	697.821
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾				121.1954	137.2243
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP				121.1105	137.1145
Ausschüttung je Anteil				2.35	2.20
Total Expense Ratio (TER)				0.70 %	0.70 %
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'053'726.10	2'014'595.22	1'938'068.65	1'605'478.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'893.000	17'233.725	15'471.917	11'438.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		133.5013	116.8984	125.2636	140.3635
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		133.4212	116.9686	125.1760	140.2513
Thesaurierung je Anteil		2.22	2.08	2.29	2.38
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %	0.70 %	0.70 %
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'275'861.27	5'713'769.01	12'175'246.23	32'332'898.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		39'079.491	48'365.928	96'240.244	228'237.244
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		135.0033	118.1362	126.5089	141.6636
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		134.9223	118.2071	126.4203	141.5502
Thesaurierung je Anteil		2.37	2.23	2.45	2.53
Total Expense Ratio (TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		683'288'070.97	414'915'228.25	398'219'088.74	419'867'518.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'950'371.300	3'448'769.588	3'102'869.452	2'933'411.473
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		138.0276	120.3082	128.3390	143.1328
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		137.9448	120.3804	128.2491	143.0183
Thesaurierung je Anteil		3.23	3.05	3.30	3.36
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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	13.80 %	2.41 %	-15.39 %	17.06 %
Klasse BA CHF	14.45 %	2.99 %	-14.91 %	17.73 %
Klasse CT CHF	14.61 %	3.13 %	-14.78 %	17.90 %
Klasse DA CHF (Schliessung 06.10.2023)	-	0.26 %	-14.72 %	18.00 %
Klasse DT CHF	14.85 %	3.17 %	-14.71 %	18.00 %
Klasse GT CHF	14.97 %	3.27 %	-14.62 %	18.12 %
Klasse NT CHF	15.66 %	3.89 %	-14.11 %	18.83 %
Benchmark	15.39 %	6.09 %	-16.48 %	23.38 %
Tracking Error 33)	2.40 %	3.09 %	2.63 %	2.82 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse AA CHF	-1.59 %
Klasse BA CHF	-0.94 %
Klasse CT CHF	-0.78 %
Klasse DT CHF	-0.54 %
Klasse GT CHF	-0.42 %
Klasse NT CHF	0.27 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	24'178'979.66	0.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	675'060'092.01	480'562'268.82
Sonstige Vermögenswerte	2'092'910.50	1'414'015.63
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	701'331'982.17	481'976'284.45
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-47'319'865.36
Andere Verbindlichkeiten	-13'238.97	-14'500.75
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	701'318'743.20	434'641'918.34

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		21'344.056	16'499.788
Ausgegebene Anteile		2'833.430	5'610.300
Zurückgenommene Anteile		-2'502.003	-766.032
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		21'675.483	21'344.056
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'160.000	1'433.000
Ausgegebene Anteile		-	70.000
Zurückgenommene Anteile		-	-343.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'160.000	1'160.000
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		90'373.302	103'547.033
Ausgegebene Anteile		3'601.676	3'630.548
Zurückgenommene Anteile		-20'290.169	-16'804.279
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		73'684.809	90'373.302
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	446.981
Zurückgenommene Anteile		-	-446.981
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		17'233.725	15'471.917
Ausgegebene Anteile		511.984	4'473.019
Zurückgenommene Anteile		-9'852.709	-2'711.211
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'893.000	17'233.725
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		48'365.928	96'240.244
Ausgegebene Anteile		236.226	10'432.080
Zurückgenommene Anteile		-9'522.663	-58'306.396
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		39'079.491	48'365.928
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'448'769.588	3'102'869.452
Ausgegebene Anteile		1'173'457.810	928'414.412
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		872'704.397	69'366.138
Zurückgenommene Anteile		-544'560.495	-651'880.414
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'950'371.300	3'448'769.588

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	13.12.2023	3'445'692.09	26'501.267
Klasse NT CHF	13.12.2023	8'363'394.20	64'323.955
Klasse NT CHF	02.04.2024	5'132'563.58	37'692.987
Klasse NT CHF	15.10.2024	106'352'392.31	744'186.188

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		434'641'918.34	426'224'273.75
Ausbezahlte Ausschüttung		-22'095.33	-30'499.95
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'132'626.19	-3'425'414.90
Saldo aus dem Anteilverkehr		196'938'297.70	37'888'825.77
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		73'893'248.68	-26'015'266.33
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		701'318'743.20	434'641'918.34

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		3'559.60	2'195.50
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		12'790'470.28	9'952'134.87
Erträge der Gratisaktien		0.00	427.11
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'093'120.69	1'797'211.86
Total Ertrag		16'887'150.57	11'751'969.34
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-159'869.18	-205'480.73
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-412'339.34	-668'036.27
Total Aufwand		-572'208.52	-873'517.00
Nettoertrag / Verlust			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'422'108.76	4'989'042.45
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		1'231'387.83	863'573.93
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		132'500.05	118'310.01
Realisierter Erfolg		20'100'938.69	16'849'378.73
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		53'792'309.99	-42'864'645.06
Gesamterfolg		73'893'248.68	-26'015'266.33

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	23'676.93	21'261.13
Vortrag des Vorjahres	1'012.19	27.92
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	24'689.12	21'289.05
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	23'843.03	20'276.86
Vortrag auf neue Rechnung	846.09	1'012.19
Total	24'689.12	21'289.05
Klasse BA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	1'993.95	1'872.76
Vortrag des Vorjahres	38.86	22.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'032.81	1'894.86
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	2'030.00	1'856.00
Vortrag auf neue Rechnung	2.81	38.86
Total	2'032.81	1'894.86
Klasse CT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	139'707.37	160'427.30
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	139'707.37	160'427.30
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	48'897.58	56'149.56
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	90'809.79	104'277.75
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	-0.01
Total	139'707.37	160'427.30
Klasse DA CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	0.00	-10.45
Vortrag des Vorjahres	0.00	10.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00
Klasse DT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	17'536.71	35'907.76
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	17'536.71	35'907.76
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'137.85	12'567.72
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	11'398.86	23'340.04
Total	17'536.71	35'907.76
Klasse GT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	92'964.38	108'063.71
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	92'964.38	108'063.71
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	32'537.53	37'822.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	60'426.85	70'241.41
Total	92'964.38	108'063.71
Klasse NT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	16'039'062.71	10'550'930.13
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	16'039'062.71	10'550'930.13
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'613'671.95	3'692'825.55
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'425'390.76	6'858'104.58
Total	16'039'062.71	10'550'930.13

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							675'060'092.01	96.25	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							675'060'092.01	96.25	
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	1'763	976	907	1'832 CHF	2'275.00	4'167'800.00	0.59	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	3'442	605	4'047	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	4'062	1'777	1'214	4'625 CHF	4'097.00	18'948'625.00	2.70	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	83'087	29'401	30'357	82'131 CHF	510.80	41'952'514.80	5.98	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	565'948	424'584	166'779	823'753 CHF	93.80	77'268'031.40	11.02	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	221'874	188'457	74'820	335'511 CHF	267.90	89'883'396.90	12.82	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	46'747	20'655	46'172	21'230 CHF	218.00	4'628'140.00	0.66	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	85'834	168'564	110'727	143'671 CHF	85.08	12'223'528.68	1.74	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	628'405	517'491	303'860	842'036 CHF	47.90	40'333'524.40	5.75	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	0	192'908	192'908	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	31'535	52'203	39'852	43'886 CHF	315.20	13'832'867.20	1.97	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	68'212	53'825	26'081	95'956 CHF	77.20	7'407'803.20	1.06	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	49'163	25'225	25'711	48'677 CHF	532.60	25'925'370.20	3.70	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	20'094	9'233	19'008	10'319 CHF	1'130.00	11'660'470.00	1.66	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	34'201	8'815	18'230	24'786 CHF	704.40	17'459'258.40	2.49	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	0	55'235	1'745	53'490 CHF	122.60	6'557'874.00	0.94	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	3'258	1'064	4'322	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	17'273	7'322	7'486	17'109 CHF	1'193.00	20'411'037.00	2.91	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	65'599	65'599	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	0	12'929	794	12'135 CHF	635.00	7'705'725.00	1.10	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	71'041	169'197	123'534	116'704 CHF	70.76	8'257'975.04	1.18	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	0	8'494	8'494	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0038863350	NESTLE SA-REG	831'853	321'536	218'720	934'669 CHF	81.58	76'250'297.02	10.87	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	111'159	1'090	112'249	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	20'330	0	20'330	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0126881561	SWISS RE AG	0	39'688	3'808	35'880 CHF	110.65	3'970'122.00	0.57	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	66'913	205'167	89'046	183'034 CHF	125.35	22'943'311.90	3.27	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	538'262	1'370'990	752'011	1'157'241 CHF	26.54	30'713'176.14	4.38	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	13'282	91'939	33'232	71'989 CHF	48.20	3'469'869.80	0.49	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	38'956	25'429	38'620	25'765 CHF	359.50	9'262'517.50	1.32	a)
CH0360674466	GALENICA AG	39'616	117'299	62'543	94'372 CHF	75.20	7'096'774.40	1.01	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	108'672	40'379	45'859	103'192 CHF	240.50	24'817'676.00	3.54	a)
CH0432492467	ALCON INC	360'615	168'920	219'846	309'689 CHF	79.58	24'645'050.62	3.51	a)
CH0435377954	SIG GROUP AG	837'101	342'093	536'403	642'791 CHF	18.59	11'949'484.69	1.70	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	12'539	14'979	14'279	13'239 CHF	572.00	7'572'708.00	1.08	a)
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	9'138	190'931	101'530	98'539 CHF	62.70	6'178'395.30	0.88	a)
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4'019	158'163	61'222	100'960 CHF	114.00	11'509'440.00	1.64	a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	141'652	61'266	184'028	18'890 CHF	68.35	11'291'131.50	0.18	a)
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	445'435	26'027	419'408 CHF	39.35	16'503'704.80	2.35	a)
CH1256740924	SGS SA-REG	0	7'973	6'477	1'496 CHF	91.50	136'884.00	0.02	a)
CH1335392721	GALDERMA GROUP AG	0	165'099	64'547	100'552 CHF	80.81	8'125'607.12	1.16	a)
CH							675'060'092.01	96.25	
Vermögensaufstellung							Kurswert CHF	in % 7)	
Bankguthaben auf Sicht							24'178'979.66	3.45	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							675'060'092.01	96.25	
Sonstige Vermögenswerte							2'092'910.50	0.30	
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode							701'331'982.17	100.00	
Andere Verbindlichkeiten							-13'238.97		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode							701'318'743.20		

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);	675'060'092.01	96.25
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.500	2.100	1.150	0.350	2.000
BA CHF	0.930	1.600	0.580	0.350	2.000
CT CHF	0.790	1.400	0.440	0.350	2.000
DT CHF	0.700	1.250	0.520	0.180	2.000
GT CHF	0.600	1.050	0.420	0.180	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Swiss Performance Index (SPI®)

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	1.10000	0.38500	0.71500
BA CHF	Nein	CHF	1.75000	0.61250	1.13750

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	1.896	0.663	1.233
DT CHF	Nein	CHF	2.221	0.777	1.444
GT CHF	Nein	CHF	2.378	0.832	1.546
NT CHF	Nein	CHF	3.239	1.133	2.106

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

13 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

Übersicht

	von	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	31.10.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'734'400'017.83	1'030'954'228.75	876'857'843.81	946'998'416.45
Klasse ASTT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		438'842'096.13	451'127'851.98	501'818'733.87	598'744'671.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'093'603.208	5'456'286.314	5'621'120.954	5'849'323.507
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.1555	82.6804	89.2738	102.3614
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		86.2417	82.7548	89.3898	102.2078
Thesaurierung je Anteil		1.99	1.22	1.17	1.46
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
Klasse NTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'295'557'921.70	579'826'376.77	375'039'109.94	348'253'744.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'947'776.252	7'026'874.744	4'416'727.933	3'526'835.063
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.6723	82.5155	84.9133	98.7440
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		86.7590	82.5898	85.0237	98.5959
Thesaurierung je Anteil		2.38	1.59	1.54	1.85
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 ASTT CHF	4.20 %	-3.80 %	-14.34 %	-1.52 %
Klasse NTH1 CHF	5.72 %	3.00 %	-12.97 %	-1.72 %
Benchmark Hedge	5.07 %	2.49 %	-	-
Benchmark	4.07 %	-3.89 %	-14.97 %	-1.77 %
Tracking Error ³³⁾	0.28 %	0.50 %	0.99 %	0.44 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse ASTT CHF	0.13 %
Klasse NTH1 CHF	0.65 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	10'212'161.62	12'247'812.13
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'705'572'544.06	1'032'216'769.02
Derivative Finanzinstrumente	2'532'899.75	-2'118'091.97
Sonstige Vermögenswerte	16'261'763.39	9'198'209.33
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'734'579'368.82	1'051'544'698.51
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-8'482.91	-20'410'707.02
Andere Verbindlichkeiten	-170'868.08	-179'762.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'734'400'017.83	1'030'954'228.75

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse ASTT CHF	von bis	Lancierung	01.11.2022
		01.11.2023 31.10.2024	31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'456'286.314	5'621'120.954
Ausgegebene Anteile		894'238.681	513'512.111
Zurückgenommene Anteile		-1'256'921.787	-678'346.751
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'093'603.208	5'456'286.314

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.11.2023	01.11.2022
		31.10.2024	31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'026'874.744	4'416'727.933
Ausgegebene Anteile		5'610'338.118	3'515'738.266
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		3'232'285.736	-
Zurückgenommene Anteile		-921'722.346	-905'591.455
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		14'947'776.252	7'026'874.744

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	13.11.2023	33'235'875.98	397'300.745
Klasse NTH1 CHF	19.03.2024	3'616'287.17	42'086.995
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	54'905'712.95	636'503.847
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	56'832'224.33	658'837.259
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	129'181'353.91	1'497'556.890

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023	01.11.2022
		31.10.2024	31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'030'954'228.75	876'857'843.81
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'565'850.53	-2'922'334.13
Saldo aus dem Anteilverkehr		643'045'903.68	208'889'312.34
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		65'965'735.93	-51'870'593.27
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'734'400'017.83	1'030'954'228.75

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 31.10.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		490'557.22	177'494.40
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-19'196.23	-24'600.90
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		42'217'452.52	18'569'836.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		8'223'354.29	2'213'464.54
Total Ertrag		50'912'167.80	20'936'194.79
Aufwand			
Passivzinsen		-1'293.37	0.00
Reglementarische Vergütungen		-2'028'713.65	-2'150'640.79
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-3'023'443.08	-897'251.97
Total Aufwand		-5'053'450.10	-3'047'892.76
Nettoertrag / Verlust		45'858'717.70	17'888'302.03
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-23'431'544.85	-35'065'588.18
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		598'149.03	575'354.14
Realisierter Erfolg		23'025'321.88	-16'601'932.01
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		42'940'414.05	-35'268'661.26
Gesamterfolg		65'965'735.93	-51'870'593.27

Verwendung des Erfolges

Klasse ASTT CHF	31.10.2024	31.10.2023
Nettoertrag	10'170'223.12	6'669'944.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'170'223.12	6'669'944.52
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'170'223.12	6'669'944.52
Total	10'170'223.12	6'669'944.52
Klasse NTH1 CHF		
Nettoertrag	35'688'494.58	11'218'357.51
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	35'688'494.58	11'218'357.51
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'490'973.10	3'926'425.13
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	23'197'521.48	7'291'932.38
Total	35'688'494.58	11'218'357.51

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'705'572'544.06	98.33	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'705'572'544.06	98.33	
AU3CB0250512	4.7500 % EBIUH 4 3/4 02/09/28 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	98.57%	558'256.63	0.03	a)
XS2231705950	4.0500 % EBIUH 4.05 09/24/25 EMTN	14'690	0	14'690	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	23'000	29'000	0	52'000 CNY	100.98%	6'369'901.56	0.37	a)
XS2297626645	0.8750 % FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN	0	700	0	700 GBP	95.20%	740'830.14	0.04	a)
XS2339427820	0.8750 % ETISLT 0 7/8 05/17/33 EMTN	2'500	6'334	8'834	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2339828498	3.5000 % EBIUH 3 1/2 05/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	101.31%	2'458'090.10	0.14	a)
XS2352309681	1.6390 % EMDEBK 1.639 06/15/26 EMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357280101	3.6700 % EBIUH 3.67 07/13/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	102.89%	1'248'188.22	0.07	a)
XS2466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	96.19%	1'625'317.95	0.09	a)
XS2623206187	5.0840 % MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2651619285	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2677030194	5.5000 % ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2707149600	5.8750 % MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS	6'950	0	6'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2765576538	5.0000 % FABUH 5 02/28/29 EMTN	0	9'875	3'375	6'500 USD	100.54%	5'650'900.97	0.33	a)
XS2811094213	5.5000 % ADGB 5 1/2 04/30/54 REGS	0	11'400	3'900	7'500 USD	101.98%	6'613'787.66	0.38	a)
XS2816006303	5.3750 % ADQABU 5 3/8 05/08/29 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	102.03%	1'764'506.82	0.10	a)
XS2830445727	5.2940 % MUBAUH 5.294 06/04/34 GMTN	0	12'000	2'500	9'500 USD	101.17%	8'311'007.84	0.48	a)
XS2865538776	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/29 EMTN	0	11'500	5'000	6'500 USD	99.79%	5'608'803.05	0.32	a)
XS2893176276	5.3610 % ADCBUH 5.361 03/10/35	0	3'800	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2907245208	5.2500 % ADQABU 5 1/4 10/02/54 REGS	0	9'000	0	9'000 USD	94.25%	7'334'739.93	0.42	a)
AE							48'284'330.87	2.78	
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	3'000	0	1'000	2'000 EUR	96.30%	1'808'124.30	0.10	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	1'800	0	0	1'800 EUR	76.27%	1'288'784.23	0.07	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	2'500	4'500	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	7'000	2'000	0	9'000 EUR	61.78%	5'219'348.00	0.30	a)
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	91.99%	1'381'642.48	0.08	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	1'000	0	0	1'000 EUR	79.01%	741'703.84	0.04	a)
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	3'200	200	1'000	2'400 EUR	101.76%	2'292'764.10	0.13	a)
XS2320746394	0.9000 % VERAU 0.9 04/01/41	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2886118079	3.2500 % OMVAU 3 1/4 09/04/31 EMTN	0	4'640	4'640	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2886118236	3.7500 % OMVAU 3 3/4 09/04/36 EMTN	0	5'280	2'780	2'500 EUR	99.26%	2'329'482.70	0.13	a)
AT							15'061'849.65	0.87	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	3'900	0	3'900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	5'500	2'000	2'500	5'000 AUD	76.79%	2'174'468.66	0.13	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	6'000	0	2'000	4'000 AUD	52.62%	1'192'113.47	0.07	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	0	2'000	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	3'500	2'500	6'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'900	2'800	2'700	4'000 AUD	84.79%	1'921'019.94	0.11	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	4'000	0	1'000	3'000 AUD	73.88%	1'255'321.31	0.07	a)
AU3CB0247393	3.7500 % SGSPA 3 3/4 09/27/24 MTN	0	500	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	1'300	0	0	1'300 AUD	74.14%	545'916.38	0.03	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	74.68%	845'965.58	0.05	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCY 2 09/17/35	0	4'500	0	4'500 AUD	71.99%	1'834'785.98	0.11	a)
AU3SG0002934	5.2500 % TCY 5 1/4 09/15/38 MTN	0	5'580	2'580	3'000 AUD	96.19%	1'634'330.47	0.09	a)
AU3TB0000200	4.2500 % ACGB 4 1/4 06/21/34 170	0	8'750	5'650	3'100 AUD	98.17%	1'723'712.93	0.10	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	4'400	0	1'400	3'000 CAD	94.43%	1'757'333.17	0.10	a)
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP503622AQ90	0.7930 % ANZ 0.793 09/17/27 12	0	800'000	0	800'000 JPY	99.83%	4'533'623.72	0.26	a)
US20271BAJ44	3.2140 % CBAAU 3.214 05/27/25 REGS	3'240	0	0	3'240 USD	99.10%	2'776'301.28	0.16	a)
US55608KAR68	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	95.75%	1'076'324.08	0.06	a)
US55608RBM16	5.2080 % MQGAU 5.208 06/15/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	100.94%	1'745'725.54	0.10	a)
US62878U2F87	5.7500 % NBNAUS 5 3/4 10/06/28 144A	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62878V2A72	1.4500 % NBNAUS 1.45 05/05/26 REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62878V2D12	1.6250 % NBNAUS 1 5/8 01/08/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	93.59%	809'290.02	0.05	a)
US63253QAG91	4.7870 % NAB 4.787 01/10/29	0	5'600	1'100	4'500 USD	100.79%	3'921'890.09	0.23	a)
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	0	1'050	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	1'500	0	0	1'500 USD	90.53%	1'174'167.48	0.07	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USQ66511AB43	5.7500 % NCMAU 5 3/4 11/15/41 REGS	2'510	1'500	4'010	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1602259985	3.5000 % CCEP 3 1/2 04/26/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
XS2187427690	3.5000 % MQGAU 3 1/2 06/24/27 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	100.76%	3'667'009.34	0.21	a)
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2463935754	3.6200 % NAB 3.62 04/01/25 GMTN	6'000	0	0	6'000 CNY	100.56%	731'917.00	0.04	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2655521610	3.0300 % NAB 3.03 07/21/26 EMTN	0	16'000	0	16'000 CNY	101.21%	1'964'472.84	0.11	a)
XS2776519980	4.0000 % MELAIR 4 06/07/34 EMTN	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2778764188	3.9740 % TCLAU 3.974 03/12/36 EMTN	0	2'675	2'675	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2809670099	4.1250 % SYDAU 4 1/8 04/30/36 EMTN	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2899382738	3.2020 % MQGAU 3.202 09/17/29 EMTN	0	7'000	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AU							37'285'689.28	2.15	
BE0312792642	0.0000 % BGTB 0 01/11/24 364D	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0390149152	5.1250 % SCRSBE 5 1/8 07/17/30	0	4'900	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0390160266	3.2900 % BPOST 3.29 10/16/29	0	3'800	0	3'800 EUR	99.72%	3'557'151.86	0.21	a)
BE0390161272	3.6320 % BPOST 3.632 10/16/34	0	4'400	0	4'400 EUR	99.80%	4'122'400.99	0.24	a)
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	15'000	13'000	2'000 USD	98.39%	1'701'539.37	0.10	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	4'400	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6352762387	3.6250 % CCBGBB 3 5/8 06/11/30 EMTN	0	10'300	2'800	7'500 EUR	101.97%	7'179'602.84	0.41	a)
USB5341FAD36	4.9320 % KBCBB 4.932 10/16/30 REGS	0	3'400	0	3'400 USD	98.99%	2'910'286.20	0.17	a)
BE							19'470'981.26	1.12	
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	95.42%	825'096.74	0.05	a)
XS2654057970	5.3750 % COMQAT 5 3/8 03/28/29 EMTN	0	7'500	3'500	4'000 USD	102.14%	3'532'783.73	0.20	a)
BM							4'357'880.47	0.25	
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	1'500	0	0	1'500 CAD	78.21%	727'723.26	0.04	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	1'050	0	1'050	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087G997	0.5000 % CANRRB 0 1/2 12/01/50 CPI	1'500	0	0	1'500 CAD	96.87%	901'353.42	0.05	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	3'000	0	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	0	3'000	0	3'000 CAD	97.16%	1'808'063.23	0.10	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	3'000	1'000	0	4'000 CAD	99.26%	2'462'932.58	0.14	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	5'000	0	5'000 CAD	85.82%	2'661'932.37	0.15	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	2'500	0	0	2'500 CAD	71.42%	1'107'541.16	0.06	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	2'000	3'000	1'000	4'000 CAD	92.19%	2'287'554.71	0.13	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	0	3'000	2'300	700 CAD	100.00%	434'226.48	0.03	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	2'000	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087R481	3.0000 % CAN 3 06/01/34	0	2'000	0	2'000 CAD	98.23%	1'218'675.22	0.07	a)
CA135087V505	4.2500 % CANRRB 4 1/4 12/01/26 CPI	1'600	0	0	1'600 CAD	195.24%	1'937'759.63	0.11	a)
CA135087WV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	2'000	0	0	2'000 CAD	208.07%	2'581'367.30	0.15	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	1'500	0	0	1'500 CAD	109.34%	1'017'401.94	0.06	a)
CA13509PHQ96	1.1000 % CANHOU 1.1 03/15/31	0	1'000	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13509PJW47	3.5000 % CANHOU 3 1/2 12/15/34	0	6'300	0	6'300 CAD	98.98%	3'868'293.55	0.22	a)
CA136375CX83	3.0500 % CNRCN 3.05 02/08/50	0	3'000	0	3'000 CAD	76.13%	1'416'719.71	0.08	a)
CA563469UF02	2.8500 % MP 2.85 09/05/46	0	1'000	0	1'000 CAD	78.74%	488'448.96	0.03	a)
CA563469UZ65	3.8000 % MP 3.8 09/05/53	3'800	5'200	0	9'000 CAD	91.36%	5'100'492.45	0.29	a)
CA642866GK79	2.6000 % NBRNS 2.6 08/14/26	700	0	700	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	0	2'700	0	2'700 CAD	104.77%	1'754'748.28	0.10	a)
CA68323AAY07	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/43	2'000	0	0	2'000 CAD	90.74%	1'125'713.53	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	0	3'500	2'700	800 CAD	97.18%	482'284.18	0.03	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA748148SA23	1.8500 % Q 1.85 02/13/27 QY	0	1'000	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	0	2'000	0	2'000 CAD	88.59%	1'099'064.44	0.06	a)
CA780086SY14	1.6700 % RY 1.67 01/28/33	0	1'000	0	1'000 CAD	93.40%	579'357.37	0.03	a)
CAC69798AZ64	4.3000 % ONTFT 4.3 06/02/34	0	6'000	0	6'000 CAD	102.75%	3'824'108.53	0.22	a)
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	5'000	0	0	5'000 CAD	102.69%	3'184'896.14	0.18	a)
US06367TQW35	0.6250 % BMO 0 5/8 07/09/24 MTN	0	6'945	6'945	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	0	1'650	0	1'650 USD	98.54%	1'405'895.84	0.08	a)
US06368LAP13	4.2500 % BMO 4 1/4 09/14/24 H	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0641596E11	0.6500 % BNS 0.65 07/31/24	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US064159MK98	3.4000 % BNS 3.4 02/11/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AN20	4.7500 % BRCOL 4 3/4 06/12/34	0	10'000	0	10'000 USD	100.67%	8'704'675.49	0.50	a)
US125094AQ51	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 144A	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12591DAC56	4.2500 % CNOOC 4 1/4 04/30/24	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	3'000	0	0	3'000 USD	99.21%	2'573'658.49	0.15	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	4'900	0	0	4'900 USD	98.72%	4'182'626.53	0.24	a)
US13607GAP90	3.1000 % CM 3.1 04/02/24	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	0	1'600	0	1'600 USD	96.58%	1'336'258.96	0.08	a)
US22411WAW64	3.2500 % CPPIBC 3 1/4 06/15/27 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	97.40%	5'895'524.60	0.34	a)
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBZ78	6.7000 % ENBCN 6.7 11/15/53	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BJU70	3.3750 % EDC 3 3/8 08/26/25	0	1'150	0	1'150 USD	99.12%	985'684.07	0.06	a)
US30216BKC53	4.1250 % EDC 4 1/8 02/13/29	0	10'600	4'600	6'000 USD	99.60%	5'167'291.55	0.30	a)
US30216BKF84	4.7500 % EDC 4 3/4 06/05/34	0	7'650	0	7'650 USD	102.83%	6'802'025.93	0.39	a)
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	1'600	1'600	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US43358BAA17	4.6250 % CANADA 4 5/8 04/30/29	0	7'120	0	7'120 USD	101.75%	6'264'220.92	0.36	a)
US563469VF90	4.9000 % MP 4.9 05/31/34	0	7'550	0	7'550 USD	101.75%	6'642'994.63	0.38	a)
US63307A2X29	5.6000 % NACN 5.6 12/18/28	0	3'750	650	3'100 USD	102.59%	2'749'943.15	0.16	a)
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	2'000	2'000	0	4'000 USD	90.14%	3'117'658.56	0.18	a)
US69376Q2E27	3.7500 % PSPCAP 3 3/4 10/02/29 REGS	0	7'500	0	7'500 USD	97.20%	6'303'922.41	0.36	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	0	5'700	5'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	2'425	2'425	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78017FT38	4.6500 % RY 4.65 10/18/30 GMTN	0	4'000	0	4'000 USD	99.00%	3'424'350.35	0.20	a)
US89114QCA40	2.6500 % TD 2.65 06/12/24 MTN	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	0	1'550	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	2'500	2'100	0	4'600 USD	94.83%	3'772'056.60	0.22	a)
USC23264AS02	4.5000 % CADEPO 4 1/2 02/13/26 REGS	4'400	0	4'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AX96	4.8750 % CADEPO 4 7/8 06/05/29 REGS	0	5'600	0	5'600 USD	101.87%	4'933'016.65	0.28	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	2'600	0	0	2'600 USD	94.64%	2'127'603.00	0.12	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	4'500	1'500	3'000 USD	104.96%	2'722'767.36	0.16	a)
USC69798AY93	4.6250 % ONTFT 4 5/8 04/10/29 REGS	0	6'290	1'290	5'000 USD	100.59%	4'348'878.95	0.25	a)
XS2027377907	1.2515 % MP 1.2515 07/18/34 EMTN	0	40'000	0	40'000 SEK	79.72%	2'577'085.00	0.15	a)
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	950	0	0	950 EUR	59.20%	527'993.55	0.03	a)
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	0	500	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2063349323	0.4780 % BRCOL 0.478 10/18/49 EMTN	0	6'500	0	6'500 EUR	51.50%	3'142'250.57	0.18	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	1'535	0	0	1'535 EUR	99.29%	1'430'792.32	0.08	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	0	1'450	0	1'450 AUD	89.77%	737'259.71	0.04	a)
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	5'500	1'000	2'500	4'000 GBP	38.54%	1'713'754.66	0.10	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTFT 0.95 11/24/51 EMTN	1'000	5'815	0	6'815 EUR	57.77%	3'695'916.82	0.21	a)
XS2539371653	3.3000 % ONTFT 3.3 10/05/29 REGS	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	3'400	700	1'200	2'900 EUR	101.50%	2'763'290.59	0.16	a)
XS2804565435	3.5000 % BNS 3 1/2 04/17/29 EMTN	0	13'100	3'100	10'000 EUR	101.09%	9'489'911.40	0.55	a)
XS2806614223	3.7500 % NACN 3 3/4 05/02/29 EMTN	0	7'500	1'500	6'000 EUR	102.18%	5'755'341.65	0.33	a)
XS2850686655	3.2500 % PSPCAP 3 1/4 07/02/34 REGS	0	2'800	800	2'000 EUR	101.55%	1'906'656.41	0.11	a)
XS2892967949	3.4670 % CCDJ 3.467 09/05/29 EMTN	0	7'000	4'000	3'000 EUR	100.86%	2'840'495.98	0.16	a)
CA							162'112'461.14	9.35	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	1'450	1'100	0	2'550 EUR	91.46%	2'189'449.01	0.13	a)
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	0	3'000	0	3'000 EUR	78.82%	2'219'845.08	0.13	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	2'900	0	1'500	1'400 EUR	96.91%	1'273'690.87	0.07	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	3'200	700	2'500 EUR	102.89%	2'414'792.40	0.14	a)
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	2'450	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	6'666	500	7'166	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22550L2J94	4.7500 % UBS 4 3/4 08/09/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US90352JAC71	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH3698DAR55	4.2820 % UBS 4.282 01/09/28 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	0	1'600	0	1'600 USD	83.42%	1'154'132.38	0.07	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	2'300	0	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2331021480	3.5500 % UBS 3.55 05/27/31 EMTN	0	23'000	0	23'000 CNY	101.83%	2'841'368.44	0.16	a)
CH							12'093'278.18	0.70	
US05890PAB22	2.8750 % BCICI 2 7/8 10/14/31 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	0	2'225	0	2'225 USD	100.24%	1'928'478.80	0.11	a)
USP2205JAT71	5.9500 % CENSUD 5.95 05/28/31 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	0	7'500	3'100	4'400 USD	104.47%	3'974'825.29	0.23	a)
USP8718AAQ96	5.5000 % SQM 5 1/2 09/10/34 REGS	0	5'075	2'075	3'000 USD	95.95%	2'489'064.89	0.14	a)
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	99.08%	562'434.10	0.03	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	2'000	0	0	2'000 EUR	56.04%	1'052'066.84	0.06	a)
XS2637387056	0.7500 % BNCHIL 0 3/4 06/16/25 EMTN	800'000	0	800'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2645248225	4.1250 % CHILE 4 1/8 07/05/34	3'600	0	0	3'600 EUR	103.04%	3'482'167.57	0.20	a)
XS2856800938	3.8750 % CHILE 3 7/8 07/09/31	0	8'800	1'300	7'500 EUR	101.48%	7'144'681.02	0.41	a)
CL							20'633'718.51	1.19	
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	15'000	0	0	15'000 CNY	114.97%	2'092'028.48	0.12	a)
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	7'000	0	7'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	106.65%	1'293'826.13	0.07	a)
CND10002D1Y9	3.8600 % CGB 3.86 07/22/49 INBK	25'000	0	0	25'000 CNY	128.00%	3'881'951.50	0.22	a)
CND10002GGR3	3.4500 % SDBC 3.45 09/20/29 1915	12'000	0	0	12'000 CNY	106.88%	1'555'939.59	0.09	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	30'000	48'000	50'000	28'000 CNY	119.43%	4'056'853.14	0.23	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	30'000	0	16'000	14'000 CNY	104.02%	1'766'689.18	0.10	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100035346	3.7900 % ADBCH 3.79 10/26/30 2010	10'000	0	0	10'000 CNY	109.41%	1'327'332.75	0.08	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	20'000	40'000	0	60'000 CNY	138.49%	10'080'518.03	0.58	a)
CND100047QT4	3.0200 % CGB 3.02 05/27/31 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	106.42%	3'873'035.01	0.22	a)
CND10007C5P4	2.3700 % CGB 2.37 01/15/29 INBK	0	13'000	0	13'000 CNY	102.30%	1'613'292.68	0.09	a)
CND10007XSY8	2.5700 % CGB 2.57 05/20/54 INBK	0	22'000	0	22'000 CNY	105.43%	2'813'777.04	0.16	a)
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	101.03%	2'451'151.00	0.14	a)
XS2800342318	3.3750 % SDBC 3 3/8 04/16/27 EMTN	0	5'750	5'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2819075578	3.6970 % ICBCAS 3.697 05/23/27 GMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CN							36'806'394.53	2.12	
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 EUR	90.91%	1'706'832.24	0.10	a)
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	35'000	0	0	35'000 CZK	106.21%	1'378'677.82	0.08	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	10'000	0	0	10'000 CZK	84.67%	314'008.52	0.02	a)
CZ0001005375	2.7500 % CZGB 2 3/4 07/23/29 105	0	25'000	0	25'000 CZK	95.58%	886'253.94	0.05	a)
CZ0001005920	1.5000 % CZGB 1 1/2 04/24/40 125	15'000	0	0	15'000 CZK	68.85%	383'052.19	0.02	a)
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2838370414	4.2500 % CEZCP 4 1/4 06/11/32 EMTN	0	6'400	1'500	4'900 EUR	101.38%	4'663'304.35	0.27	a)
XS2852933329	4.5700 % CESSPO 4.57 07/03/31 EMTN	0	8'600	1'300	7'300 EUR	102.93%	7'053'523.79	0.41	a)
XS2894908768	4.1250 % CEZCP 4 1/8 09/05/31 EMTN	0	8'600	4'600	4'000 EUR	100.99%	3'792'247.07	0.22	a)
CZ							20'177'899.92	1.16	
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	0	900	900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030583	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/33 I/L	0	6'000	4'000	2'000 EUR	116.99%	2'196'552.08	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	5'200	4'800	0	10'000 EUR	52.20%	4'899'850.88	0.28	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	4'000	4'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	3'000	3'500	2'500	4'000 EUR	98.82%	3'710'837.92	0.21	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	0	4'000	0	4'000 EUR	95.63%	3'590'939.66	0.21	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	0	8'000	0	8'000 EUR	90.23%	6'775'960.08	0.39	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	2'000	16'000	2'000	16'000 EUR	77.64%	11'661'936.10	0.67	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	2'000	3'000	1'000	4'000 EUR	91.80%	3'447'196.94	0.20	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	4'500	3'000	1'500	6'000 EUR	49.59%	2'793'013.57	0.16	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'000	9'000	6'000	5'000 EUR	95.95%	4'503'694.72	0.26	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	0	2'500	600	1'900 EUR	108.90%	1'942'456.91	0.11	a)
DE000A2TSTE8	0.7500 % SAPGR 0 3/4 12/10/24	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A352ED1	2.6250 % KFW 2 5/8 01/10/34 EMTN	0	12'000	7'000	5'000 EUR	98.83%	4'638'922.91	0.27	a)
DE000A3823H4	4.8510 % ALVGR 4.851 07/26/54	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	6'500	2'500	4'000 EUR	101.89%	3'825'854.63	0.22	a)
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	7'000	0	1'000	6'000 EUR	59.00%	3'323'318.34	0.19	a)
DE000A3TOX22	0.2500 % PBBGR 0 1/4 10/27/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU0E071	0.0000 % BUBILL 0 07/17/24 364D	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	2'000	8'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU2Z023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000LB2ZTL3	2.0000 % LBBW 2 02/24/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 USD	99.06%	2'569'663.58	0.15	a)
US251526CE71	2.1290 % DB 2.129 11/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	96.85%	1'674'872.02	0.10	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CW79	5.4140 % DB 5.414 05/10/29	0	3'200	0	3'200 USD	101.49%	2'808'130.54	0.16	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	100'000	300'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US500769BR40	0.0000 % KFW 0 04/18/36	1'000	2'000	0	3'000 USD	59.79%	1'551'090.21	0.09	a)
US500769HX53	2.6250 % KFW 2 5/8 02/28/24	2'150	0	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	2'000	500	0	2'500 CAD	96.85%	1'501'911.85	0.09	a)
US500769JV79	3.3750 % KFW 3 3/8 08/23/24	0	13'000	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769KD52	4.3750 % KFW 4 3/8 02/28/34	0	9'100	0	9'100 USD	100.17%	7'881'753.47	0.45	a)
US515110BN30	2.0000 % RENTEN 2 01/13/25	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	1'300	0	0	1'300 USD	95.74%	1'076'267.88	0.06	a)
US515110BT00	2.5000 % RENTEN 2 1/2 11/15/27 37	1'200	0	0	1'200 USD	95.17%	987'490.86	0.06	a)
US515110CA00	0.8750 % RENTEN 0 7/8 03/30/26	0	2'350	0	2'350 USD	95.18%	1'934'120.75	0.11	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 USD	98.92%	855'369.89	0.05	a)
XS1388661735	1.2500 % DHLGR 1 1/4 04/01/26 EMTN	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1721762240	7.4600 % RENTEN 7.46 11/22/27 EMTN	0	40'000	0	40'000 MXN	92.48%	1'596'423.79	0.09	a)
XS1772374770	1.6250 % DBHNGR 1 5/8 08/16/33 EMTN	0	7'000	2'500	4'500 EUR	90.07%	3'805'098.68	0.22	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	1'400	0	0	1'400 EUR	83.72%	1'100'326.55	0.06	a)
XS2270142966	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 12/08/50 EMTN	0	8'379	0	8'379 EUR	52.12%	4'099'685.66	0.24	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	16'000	0	16'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2331271242	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 04/15/36 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2338980746	0.3750 % FMSWER 0 3/8 05/06/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	2'692	0	0	2'692 EUR	59.85%	1'512'593.38	0.09	a)
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	2'300	0	0	2'300 EUR	83.67%	1'806'448.61	0.10	a)
XS2391406530	0.3500 % DBHNGR 0.35 09/29/31 EMTN	0	7'000	0	7'000 EUR	84.37%	5'543'951.98	0.32	a)
XS2422922943	1.0000 % BYLAN 1 12/20/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2451378181	2.7500 % KFW 2 3/4 03/03/25 EMTN	30'000	40'000	0	70'000 CNY	100.15%	8'504'979.13	0.49	a)
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	7'000	69'000	27'000	49'000 CNY	101.04%	6'006'152.16	0.35	a)
XS2624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	2'700	0	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	105.37%	1'088'097.34	0.06	a)
XS2712037055	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 NOV	0	55'000	55'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2745726047	4.0000 % VW 4 04/11/31 EMTN	0	2'925	2'925	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2756954835	4.1250 % KFW 4 1/8 01/31/28 EMTN	0	15'000	7'000	8'000 USD	99.72%	6'897'884.84	0.40	a)
XS2760775549	4.1250 % RENTEN 4 1/8 02/06/31 EMTN	0	3'500	0	3'500 USD	98.79%	2'989'860.22	0.17	a)
XS2808428853	2.7500 % KFW 2 3/4 04/26/27 EMTN	0	90'000	40'000	50'000 CNY	101.54%	6'159'115.57	0.36	a)
XS2826735925	1.0170 % DB 1.017 06/03/27	0	1'100'000	0	1'100'000 JPY	99.07%	6'186'088.23	0.36	a)
XS2837886287	3.8750 % VW 3 7/8 09/10/30	0	3'750	3'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2844398482	4.2500 % SDFGR 4 1/4 06/19/29	0	8'900	8'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2878460885	3.8750 % KFW 3 7/8 10/01/29 EMTN	0	7'000	2'000	5'000 GBP	97.71%	5'431'051.22	0.31	a)
XS2924823532	4.0000 % LBANK 4 01/22/27 EMTN	0	11'300	0	11'300 USD	99.47%	9'719'225.41	0.56	a)
DE							152'598'188.56	8.80	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	5'000	0	0	5'000 DKK	126.07%	793'421.51	0.05	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	3'000	0	0	3'000 DKK	95.73%	361'484.99	0.02	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	6'000	0	0	6'000 DKK	86.54%	653'559.36	0.04	a)
US23636ABD28	3.7730 % DANBNK 3.773 03/28/25 144A	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	2'500	2'200	0	4'700 USD	95.25%	3'871'005.08	0.22	a)
DK							5'679'470.94	0.33	
XS2888497067	4.0420 % LUMINO 4.042 09/10/28 EMTN	0	9'200	0	9'200 EUR	100.51%	8'680'971.78	0.50	a)
EE							8'680'971.78	0.50	
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	1'300	150	0	1'450 EUR	67.49%	918'701.15	0.05	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0L02406079	0.0000 % SGLT 0 06/07/24 12M	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	100'000	0	0	100'000 JPY	99.96%	567'429.58	0.03	a)
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	0	1'800	0	1'800 USD	96.89%	1'508'007.40	0.09	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	4'400	0	4'400 USD	101.52%	3'862'473.09	0.22	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	1'400	0	0	1'400 USD	94.11%	1'139'216.31	0.07	a)
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2076079594	0.6250 % SABSM 0 5/8 11/07/25	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	0	2'000	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2645244745	0.7580 % SANSCF 0.758 07/07/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.74%	2'264'654.72	0.13	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	500'000	0	0	500'000 JPY	99.36%	2'820'089.47	0.16	a)
XS2645245395	1.0650 % SANSCF 1.065 07/07/28 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	97.84%	1'110'835.45	0.06	a)
XS2661068234	5.2500 % FCCSER 5 1/4 10/30/29	5'100	0	5'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2698998593	5.1250 % ANESM 5 1/8 04/23/31 EMTN	7'800	0	7'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2835902243	3.6250 % BBVASM 3 5/8 06/07/30	0	10'800	3'800	7'000 EUR	102.05%	6'705'891.13	0.39	a)
XS2898158485	5.0000 % SABSM 5 10/13/29 EMTN	0	5'200	5'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2905583014	3.7150 % FCCSER 3.715 10/08/31	0	8'600	1'600	7'000 EUR	99.24%	6'521'631.58	0.38	a)
XS2926265765	2.6500 % ICO 2.65 10/30/34 EMTN	0	100'000	0	100'000 CNY	95.58%	11'595'085.07	0.67	a)
ES							39'014'014.95	2.25	
US65559D2E87	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 REGS	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1241947768	2.3750 % FINNVE 2 3/8 06/04/25 REGS	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2242924491	0.0000 % KUNTA 0 10/14/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	85.66%	964'923.75	0.06	a)
XS2584643113	3.6250 % NDAFH 3 5/8 02/10/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	100.13%	1'879'976.89	0.11	a)
XS2599779597	4.2500 % NESVFH 4 1/4 03/16/33 EMTN	0	6'300	0	6'300 EUR	102.41%	6'056'829.63	0.35	a)
XS2718201515	3.8750 % NESVFH 3 7/8 05/21/31 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2914674408	3.6250 % KUNTA 3 5/8 10/09/29 REGS	0	10'800	0	10'800 USD	97.25%	9'081'850.71	0.52	a)
FI							17'983'580.98	1.04	
AU3CB0306017	5.4110 % ACAFP 5.411 01/18/29 MTN	0	3'950	3'950	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 OAT	0	2'500	0	2'500 EUR	82.21%	1'929'454.16	0.11	a)
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013425451	1.7500 % BFCM 1 3/4 12/19/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	99.48%	2'211'774.72	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	100'000	200'000	0	300'000 JPY	95.82%	1'631'852.49	0.09	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	0	6'000	2'000	4'000 USD	73.16%	2'530'388.90	0.15	a)
FR0013483914	1.0000 % SOGRPR 1 02/18/70 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	41.23%	774'100.40	0.04	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 OAT	0	6'000	3'000	3'000 EUR	65.60%	1'847'561.55	0.11	a)
FR0014000C08	0.8750 % SNCF 0 7/8 02/28/51	800	0	0	800 EUR	48.36%	363'201.97	0.02	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002GB5	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 05/25/36 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140060B0	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	0	5'000	1'000	4'000 EUR	53.92%	2'024'714.70	0.12	a)
FR0014006TX3	0.7500 % VDP 0 3/4 11/30/41 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	62.62%	881'761.94	0.05	a)
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	1'800	1'000	0	2'800 EUR	94.25%	2'477'384.13	0.14	a)
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 OAT	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	400'000	100'000	0	500'000 JPY	98.46%	2'794'686.33	0.16	a)
FR001400F0V4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	103.09%	1'741'928.67	0.10	a)
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GGZ0	4.1250 % BFCM 4 1/8 03/13/29 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	103.86%	2'437'416.48	0.14	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	2'700	0	900	1'800 GBP	102.84%	2'057'953.02	0.12	a)
FR001400KWR6	6.0000 % ELOFR 6 03/22/29 EMTN	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFF 5 1/2 10/09/28 EMTN	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400LH44	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 10/19/26	300'000	0	0	300'000 JPY	99.70%	1'697'826.87	0.10	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400M2G2	5.7500 % RCFFP 5 3/4 11/22/31 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400NC70	3.8750 % AYVFP 3 7/8 01/24/28	0	8'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400O457	3.8750 % AYVFP 3 7/8 02/22/27	0	5'400	5'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	2'300	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400P8C5	4.0000 % TISSEO 4 04/08/39 EMTN	0	10'400	6'700	3'700 EUR	98.06%	3'405'988.25	0.20	a)
FR001400PGC0	4.3750 % ACAFP 4 3/8 04/15/36	0	4'400	1'900	2'500 EUR	101.15%	2'373'979.86	0.14	a)
FR001400QIH3	5.3750 % BPCEGP 5 3/8 10/22/31 EMTN	0	4'000	0	4'000 GBP	98.67%	4'387'752.65	0.25	a)
FR001400QMF9	3.0000 % FRTR 3 11/25/34 OAT	0	8'000	5'000	3'000 EUR	98.94%	2'786'395.32	0.16	a)
FR001400SJS4	3.5000 % AKEFP 3 1/2 09/12/34 EMTN	0	3'600	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400TMR8	5.7500 % ENGIFP 5 3/4 10/28/50 EMTN	0	2'500	0	2'500 GBP	95.93%	2'666'166.06	0.15	a)
FR0127921064	0.0000 % BTF 0 04/17/24	0	7'000	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0127921312	0.0000 % BTF 0 07/10/24 51W	0	7'000	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0127921338	0.0000 % BTF 0 09/04/24 51W	0	30'000	30'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128071059	0.0000 % BTF 0 10/02/24 51W	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227685	0.0000 % BTF 0 04/04/24	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227701	0.0000 % BTF 0 04/10/24	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227735	0.0000 % BTF 0 05/23/24 13W	0	9'000	9'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227750	0.0000 % BTF 0 06/19/24 13W	0	15'000	15'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227768	0.0000 % BTF 0 07/24/24 27W	0	8'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128379387	0.0000 % BTF 0 07/03/24 13W	0	11'000	11'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128379403	0.0000 % BTF 0 07/31/24 13W	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128379411	0.0000 % BTF 0 08/14/24 13W	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128379429	0.0000 % BTF 0 08/28/24 13W	0	11'000	11'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.63%	5'655'733.05	0.33	a)
JP525020BPA4	1.2030 % BFCM 1.203 10/16/28 42	300'000	0	0	300'000 JPY	100.26%	1'707'431.81	0.10	a)
JP525020CQA0	1.5630 % BFCM 1.563 10/13/34 46	0	1'400'000	0	1'400'000 JPY	99.04%	7'871'295.84	0.45	a)
JP525022ANC3	0.7630 % ACAFP 0.763 12/05/25 17	400'000	0	0	400'000 JPY	99.99%	2'270'535.76	0.13	a)
JP525022AQ16	0.7240 % ACAFP 0.724 01/26/27 22	0	600'000	0	600'000 JPY	99.61%	3'392'622.39	0.20	a)
JP525023BL76	0.0700 % CDCEPS 0.07 07/30/24 9	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05578BAV80	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/14/25 REGS	0	2'590	0	2'590 USD	99.29%	2'223'627.24	0.13	a)
US05578QAB95	5.1500 % BPCEGP 5.15 07/21/24 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06675GAY17	1.6040 % BFCM 1.604 10/04/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	94.38%	2'040'238.03	0.12	a)
US09659X2K76	3.0520 % BNP 3.052 01/13/31 REGS	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'200	0	0	2'200 USD	95.75%	1'821'452.50	0.11	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	103.04%	1'782'025.64	0.10	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	0	4'200	4'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	1'750	0	1'750 USD	100.95%	1'527'600.64	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USF11494CF05	5.9360 % BPCEGP 5.936 05/30/35 REGS	0	2'100	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF2893TAQ97	4.9500 % EDF 4.95 10/13/45 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF2893TBG07	6.0000 % EDF 6 04/22/64 REGS	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1490307516	2.5600 % ACAFP 2.56 12/20/23 EMTN	1'024	0	1'024	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR							73'314'851.37	4.23	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	0	1'640	0	1'640 AUD	99.64%	925'498.26	0.05	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'500	0	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	2'000	0	0	2'000 GBP	54.39%	1'209'375.66	0.07	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	500	1'400	0	1'900 GBP	56.33%	1'189'799.71	0.07	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	0	3'000	3'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	3'000	0	3'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	2'000	1'700	0	3'700 GBP	74.84%	3'078'513.95	0.18	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'900	2'240	0	5'140 GBP	48.55%	2'773'989.33	0.16	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	9'500	36'500	21'000	25'000 GBP	28.61%	7'951'167.48	0.46	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	3'000	0	3'000 GBP	76.95%	2'566'229.65	0.15	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	7'900	11'500	2'400	17'000 GBP	67.63%	12'780'588.05	0.74	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	0	1'500	0	1'500 GBP	48.02%	800'691.93	0.05	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	0	800	0	800 GBP	82.67%	735'208.26	0.04	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	7'600	0	1'100	6'500 GBP	72.92%	5'269'170.79	0.30	a)
JP582666CG91	1.2070 % HSBC 1.207 09/25/26 3	200'000	0	0	200'000 JPY	100.08%	1'136'210.21	0.07	a)
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63859VBF76	1.0000 % NWDI 1 08/28/25 REGS	1'900	2'000	0	3'900 USD	96.98%	3'270'620.53	0.19	a)
US63861WAK18	5.1270 % NWDI 5.127 07/29/29 REGS	0	9'150	3'150	6'000 USD	100.63%	5'220'937.54	0.30	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AK45	5.8080 % NWG 5.808 09/13/29	2'300	0	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63906YAJ73	5.4100 % NWG 5.41 05/17/29 144A	0	9'500	3'500	6'000 USD	101.87%	5'285'426.87	0.30	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG6398ADD66	5.2640 % NWDI 5.264 11/10/26 REGS	0	4'100	800	3'300 USD	101.44%	2'894'486.40	0.17	a)
USG84228GC69	6.0970 % STANLN 6.097 01/11/35 REGS	0	5'350	5'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	99.93%	1'110'901.13	0.06	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	0	2'500	0	2'500 GBP	95.76%	2'661'496.91	0.15	a)
XS1527126772	1.1170 % BPLN 1.117 01/25/24 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1699636574	2.2500 % LLOYDS 2 1/4 10/16/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1876165819	0.0000 % HSBC FLOAT 09/28/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2078692014	3.5160 % STANLN 3.516 02/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.26%	858'301.22	0.05	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	900	500	1'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2287624154	1.5000 % MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	57.18%	953'539.78	0.05	a)
XS2322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	0	500	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	0	4'812	0	4'812 USD	95.05%	3'955'011.66	0.23	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	600'000	500'000	0	1'100'000 JPY	98.28%	6'136'757.88	0.35	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2423041107	3.2600 % GS 3.26 07/08/24 EMTN	3'250	0	3'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	94.91%	1'641'442.72	0.09	a)
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	0	800	0	800 GBP	62.62%	556'944.69	0.03	a)
XS2593105393	3.6250 % AZN 3 5/8 03/03/27 EMTN	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618731256	4.8740 % STANLN 4.874 05/10/31	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2662538425	4.9180 % BACR 4.918 08/08/30 EMTN	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	1'900	2'200	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	2'400	2'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	3'600	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	0	1'350	1'350	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	5'600	1'700	3'900 EUR	102.00%	3'734'198.93	0.22	a)
XS2754450612	5.4750 % GS 5.475 02/24/25 EMTN	0	7'000	0	7'000 USD	100.28%	6'069'606.00	0.35	a)
XS2758114321	3.2500 % CPGLN 3 1/4 02/06/31 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2779881601	3.7500 % AALLN 3 3/4 06/15/29	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2838537566	4.0000 % MOTOPG 4 01/17/30 EMTN	0	7'200	4'200	3'000 EUR	102.96%	2'899'525.13	0.17	a)
XS2838538374	4.2500 % MOTOPG 4 1/4 06/17/35 EMTN	0	5'600	2'100	3'500 EUR	104.20%	3'423'685.73	0.20	a)
XS2866379220	3.8280 % NWISE 3.828 07/24/32 EMTN	0	8'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2914003533	5.0050 % STANLN 5.005 10/15/30 REGS	0	9'100	0	9'100 USD	98.77%	7'771'590.69	0.45	a)
GB							98'860'917.09	5.70	
HK0000929999	3.3000 % HKINTL 3.3 06/07/33 GMTN	0	22'000	0	22'000 CNY	105.87%	2'825'466.75	0.16	a)
HK0001031944	3.3750 % HKINTL 3 3/8 07/24/31 GMTN	0	11'100	11'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HK0001031969	2.8000 % HKINTL 2.8 07/24/34 GMTN	0	49'000	0	49'000 CNY	102.04%	6'065'833.25	0.35	a)
JP534411AQ66	0.8080 % HSBC 0.808 06/25/27 4	0	500'000	0	500'000 JPY	99.78%	2'831'953.74	0.16	a)
XS1138283236	4.0800 % CCB 4.08 11/18/24 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	100.15%	1'214'997.02	0.07	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	1'450	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HK							12'938'250.76	0.75	
AT0000A39UM6	4.8750 % ERSTEI 4 7/8 01/31/29 EMTN	0	2'300	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HR							0.00	0.00	
JP536000BQ59	1.3300 % INDON 1.33 05/25/29 32	0	200'000	0	200'000 JPY	100.36%	1'139'445.92	0.07	a)
ID							1'139'445.92	0.07	
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	4'400	6'600	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2695009998	7.8750 % GLJGR 7 7/8 04/06/27 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2828685631	5.7500 % GLJGR 5 3/4 07/06/29 EMTN	0	10'350	10'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2905582479	5.1250 % GLJGR 5 1/8 01/04/29 EMTN	0	15'000	8'100	6'900 EUR	100.20%	6'490'065.82	0.37	a)
IE							6'490'065.82	0.37	
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	1'500	0	1'500	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	2'000	0	2'000	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL							0.00	0.00	
XS2182399274	0.6250 % ICELND 0 5/8 06/03/26	2'040	0	2'040	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2411726438	0.7500 % LANBNN 0 3/4 05/25/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2671896418	6.4230 % LANBNN FLOAT 08/25/25 EMTN	30'000	0	0	30'000 SEK	101.72%	2'465'959.44	0.14	a)
XS2679765037	6.3750 % LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779814750	5.0000 % LANBNN 5 05/13/28 EMTN	0	2'050	2'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2788435050	3.5000 % ICELND 3 1/2 03/21/34	0	2'450	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2792180197	4.6250 % ISLBAN 4 5/8 03/27/28	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2817920080	4.6250 % ARION 4 5/8 11/21/28 EMTN	0	3'400	1'000	2'400 EUR	103.44%	2'330'502.19	0.13	a)
XS2913946989	3.7500 % LANBNN 3 3/4 10/08/29 EMTN	0	10'250	2'250	8'000 EUR	99.30%	7'457'573.98	0.43	a)
IS							12'254'035.61	0.71	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	3'900	0	900	3'000 EUR	99.89%	2'813'117.38	0.16	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005568123	4.7500 % CDEP 4 3/4 10/18/30 EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005570988	4.6000 % UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN	0	6'100	6'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	7'400	7'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005596470	4.0500 % BTPS 4.05 10/30/37 13Y	0	6'900	6'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26 5Y	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51 30Y	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	500'000	200'000	0	700'000 JPY	99.77%	3'964'377.60	0.23	a)
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2638075700	6.6250 % ISPIM 6 5/8 06/20/33 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2739132897	3.8750 % ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2767499945	3.8750 % SRGIM 3 7/8 02/19/34 EMTN	0	6'900	6'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2770512064	4.7500 % ENELIM 4 3/4 PERP	0	6'650	6'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52811681779	5.5000 % ENIIM 5 1/2 05/15/34 REGS	0	1'900	400	1'500 USD	100.47%	1'303'185.05	0.08	a)
X52811682587	5.9500 % ENIIM 5.95 05/15/54 REGS	0	9'500	0	9'500 USD	99.38%	8'163'472.73	0.47	a)
IT							16'244'152.76	0.94	
X52839195877	4.2500 % APTV 4 1/4 06/11/36	0	7'800	7'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JE							0.00	0.00	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	0	400'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	0	600'000	500'000	100'000 JPY	97.64%	554'276.71	0.03	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	0	500'000	400'000	100'000 JPY	96.85%	549'769.43	0.03	a)
JP1103661N43	0.2000 % JGB 0.2 03/20/32 366	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103681NA2	0.2000 % JGB 0.2 09/20/32 368	0	300'000	100'000	200'000 JPY	96.05%	1'090'501.58	0.06	a)
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	0	1'000'000	600'000	400'000 JPY	97.88%	2'222'556.46	0.13	a)
JP1120201F51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/25 20	500'000	0	0	500'000 JPY	111.93%	3'177'014.67	0.18	a)
JP1120241K56	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/29 24	500'000	0	200'000	300'000 JPY	114.39%	1'948'095.43	0.11	a)
JP1120261M59	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/31 26	200'000	0	0	200'000 JPY	116.07%	1'317'782.07	0.08	a)
JP1120291Q59	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/34 29	0	400'000	0	400'000 JPY	105.84%	2'403'347.05	0.14	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	200'000	200'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	750'000	850'000	500'000	1'100'000 JPY	105.49%	6'587'350.04	0.38	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	500'000	800'000	100'000	1'200'000 JPY	102.05%	6'951'526.09	0.40	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	0	500'000	0	500'000 JPY	102.82%	2'918'437.95	0.17	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	0	400'000	0	400'000 JPY	84.42%	1'916'833.18	0.11	a)
JP1300131A20	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	1'000'000	300'000	1'200'000	100'000 JPY	110.14%	625'206.83	0.04	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	500'000	0	0	500'000 JPY	106.86%	3'033'078.51	0.17	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	400'000	0	0	400'000 JPY	103.83%	2'357'729.56	0.14	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	300'000	0	0	300'000 JPY	101.84%	1'734'407.39	0.10	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	600'000	0	0	600'000 JPY	72.00%	2'452'291.70	0.14	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	400'000	0	0	400'000 JPY	75.30%	1'709'747.90	0.10	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	200'000	500'000	0	700'000 JPY	71.88%	2'856'238.57	0.16	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	89.62%	5'087'213.55	0.29	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	0	1'500'000	0	1'500'000 JPY	82.30%	7'007'776.31	0.40	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	700'000	1'300'000	0	2'000'000 JPY	58.92%	6'689'740.31	0.39	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	300'000	0	0	300'000 JPY	69.20%	1'178'444.71	0.07	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	500'000	200'000	0	700'000 JPY	56.34%	2'238'848.53	0.13	a)
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.59%	1'130'658.42	0.07	a)
JP316572BQA5	0.9230 % NTT 0.923 12/20/29 36	0	300'000	0	300'000 JPY	100.05%	1'703'872.53	0.10	a)
JP316572DLC8	0.3800 % NTT 0.38 09/20/30 18	100'000	0	0	100'000 JPY	96.85%	549'769.43	0.03	a)
US471048CM82	1.8750 % JBIC 1 7/8 04/15/31	0	11'000	0	11'000 USD	85.41%	8'123'942.97	0.47	a)
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	3'500	0	1'200	2'300 USD	102.57%	2'039'882.64	0.12	a)
US86562MAA80	4.4360 % SUMIBK 4.436 04/02/24 144A	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBM10	2.6960 % SUMIBK 2.696 07/16/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBV19	2.3480 % SUMIBK 2.348 01/15/25	0	2'188	0	2'188 USD	99.44%	1'881'406.44	0.11	a)
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	0	650	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCT53	5.4640 % SUMIBK 5.464 01/13/26	3'600	0	0	3'600 USD	100.88%	3'140'407.08	0.18	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	0	2'350	2'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	1'350	1'350	0	2'700 USD	95.22%	2'223'161.86	0.13	a)
USJ7771YSX69	5.2000 % SUMITR 5.2 03/07/29 REGS	0	3'600	700	2'900 USD	101.32%	2'540'680.56	0.15	a)
X50257403278	2.3000 % DBJJP 2.3 03/19/26 INTL	340'000	170'000	240'000	270'000 JPY	102.38%	1'569'166.62	0.09	a)
X50432572344	2.8500 % JAPEXP 2.85 03/18/39 1	230'000	0	0	230'000 JPY	113.79%	1'485'670.60	0.09	a)
X52059791231	2.2000 % CJRAIL 2.2 10/02/24	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52536439354	4.3750 % DBJJP 4 3/8 09/22/25 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	99.68%	6'033'530.72	0.35	a)
X52613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	7'000	0	2'000	5'000 USD	98.79%	4'271'055.95	0.25	a)
X52673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	3'800	0	800	3'000 EUR	108.88%	3'066'417.65	0.18	a)
X52698464885	4.0860 % SUMITR 4.086 04/19/28 EMTN	6'000	0	3'000	3'000 EUR	103.53%	2'915'775.04	0.17	a)
X52799473637	3.3840 % ASABRE 3.384 04/16/29	0	3'300	0	3'300 EUR	100.67%	3'118'752.50	0.18	a)
X52886269286	3.7670 % MIZUHO 3.767 08/27/34 EMTN	0	9'800	1'800	8'000 EUR	100.53%	7'549'722.53	0.44	a)
X52891034063	3.5330 % EJRAIL 3.533 09/04/36 EMTN	0	7'100	2'100	5'000 EUR	100.50%	4'717'121.50	0.27	a)
X52892386462	3.5560 % MUFU 3.556 09/05/32 EMTN	0	9'750	6'750	3'000 EUR	100.30%	2'824'809.33	0.16	a)
JP							129'494'018.90	7.47	
JP541037AP66	0.7600 % KOREAN 0.76 06/29/26 3	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KR10350172C8	3.0000 % KTB 3 12/10/42 4212	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	99.54%	1'871'045.40	0.11	a)
KR103501GA35	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/25 2503	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	99.51%	1'870'628.19	0.11	a)
KR103502G3C1	3.7500 % KTB 3 3/4 12/10/33 3312	8'000'000	0	0	8'000'000 KRW	104.96%	5'261'192.31	0.30	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	101.00%	1'898'477.31	0.11	a)
KR103503GB99	1.8750 % KTB 1 7/8 09/10/41 4109	0	6'000'000	0	6'000'000 KRW	84.86%	3'190'490.11	0.18	a)
US50066RAS58	2.1250 % KOROIL 2 1/8 04/18/27 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	95.29%	1'071'153.18	0.06	a)
USY3815NBG52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	0	2'200	700	1'500 USD	100.40%	1'302'264.14	0.08	a)
USY3815NBH36	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/29 REGS	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY4938AAJ89	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/27 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	100.58%	869'697.97	0.05	a)
USY4938AAL36	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/29 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY555CGAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	100.26%	6'068'637.54	0.35	a)
USY555CGAM49	5.5000 % LGENSO 5 1/2 07/02/34 REGS	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52322585196	2.8500 % EIBKOR 2.85 03/25/24 EMTN	14'000	0	14'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52369288886	3.2000 % HYUCAP 3.2 08/11/24 GMTN	17'000	0	17'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	2'200	0	0	2'200 USD	94.86%	1'804'540.70	0.10	a)
X52690013052	5.7500 % KOLAHO 5 3/4 10/06/25	6'000	0	3'000	3'000 USD	100.58%	2'609'197.66	0.15	a)
X52740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	0	1'700	500	1'200 EUR	101.02%	1'138'012.08	0.07	a)
X52775400703	5.5000 % SHINCA 5 1/2 03/12/29	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
KR							28'955'336.59	1.67	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51986376371	8.1600 % ADCBUH 8.16 04/29/29 EMTN	0	30'000'000	0	30'000'000 IDR	100.68%	1'663'954.89	0.10	a)
X52162033729	2.6250 % QNBK 2 5/8 05/12/25 EMTN	0	7'000	0	7'000 USD	98.57%	5'966'343.53	0.34	a)
X52181280848	3.6000 % QNBK 3.6 06/05/25 EMTN	20'000	12'000	0	32'000 CNY	100.58%	3'904'644.29	0.23	a)
X52196300698	3.8500 % QNBK 3.85 07/10/25 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	100.98%	1'224'993.20	0.07	a)
X52223675146	3.5000 % QNBK 3 1/2 03/09/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CNY	101.22%	613'982.68	0.04	a)
X52227817876	3.8000 % QNBK 3.8 09/15/25 EMTN	13'120	0	0	13'120 CNY	101.13%	1'609'626.26	0.09	a)
X52299092747	3.2800 % QNBK 3.28 02/18/24 EMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	10'000	5'000	15'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52454678009	4.0000 % QNBK 4 03/14/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	102.79%	1'246'975.09	0.07	a)
KY							16'230'519.94	0.94	
X52765498717	3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	0	8'050	8'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52841247583	3.5000 % LITHUN 3 1/2 07/03/31 EMTN	0	9'500	9'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LT							0.00	0.00	
DE000A3LWGF9	3.7500 % TRAGR 3 3/4 03/27/30 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU2773894873	2.8750 % LGB 2 7/8 03/01/34	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51761721262	1.6250 % ARNDTN 1 5/8 01/31/28 EMTN	2'800	0	500	2'300 EUR	93.13%	2'010'790.09	0.12	a)
X51964701822	5.3750 % ARNDTN 5 3/8 03/21/29 EMTN	900	0	0	900 USD	95.59%	743'925.62	0.04	a)
X52286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	83.27%	1'328'865.47	0.08	a)
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52432162654	1.7500 % CPIPGR 1 3/4 01/14/30 EMTN	3'800	0	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52529520715	3.6250 % PRIFII 3 5/8 03/07/30 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	100.60%	5'666'459.98	0.33	a)
X52847688251	4.3750 % PRIFII 4 3/8 07/01/36 EMTN	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52860457071	4.8000 % ARNDTN 4.8 07/16/29 EMTN	0	4'300	4'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							9'750'041.16	0.56	
JP548400BQ84	1.7200 % MEX 1.72 08/28/29 7	0	1'400'000	0	1'400'000 JPY	99.60%	7'915'880.49	0.46	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	300'000	0	300'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
USP1581BAC21	5.2500 % BBVASM 5 1/4 09/10/29 REGS	0	4'250	1'750	2'500 USD	99.48%	2'150'400.81	0.12	a)
X50699618350	5.0000 % AMXLMM 5 10/27/26	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52754067242	4.4899 % MEX 4.4899 05/25/32	0	5'900	2'500	3'400 EUR	100.20%	3'198'290.71	0.18	a)
MX							13'264'572.01	0.76	
MYBM12300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	10'000	3'000	0	13'000 MYR	99.74%	2'560'321.55	0.15	a)
MYBM02200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	10'000	10'000	0	20'000 MYR	97.83%	3'863'761.49	0.22	a)
MY							6'424'083.04	0.37	
CA639832AA25	5.2000 % NEDWBK 5.2 03/31/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CAD	100.60%	624'026.87	0.04	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0015001WE3	0.0000 % DTB 0 06/27/24	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	1'000	0	0	1'000 EUR	48.45%	454'847.35	0.03	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	2'300	0	4'300 USD	96.50%	3'587'886.74	0.21	a)
US822582CC49	2.0000 % RDSALN 2 11/07/24	0	600	0	600 USD	99.94%	518'524.27	0.03	a)
USN30706VC11	1.3750 % ENELIM 1 3/8 07/12/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	2'300	3'000	800	4'500 USD	97.52%	3'794'727.30	0.22	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	83.04%	2'338'551.11	0.13	a)
XS1596070547	3.0000 % MUBAUH 3 04/19/24 GMTN	2'195	0	2'195	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1987905913	1.9700 % RABOBK 1.97 05/29/24 EMTN	1'334	0	1'334	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2065581212	1.5000 % BNG 1 1/2 10/16/24 REGS	2'000	10'000	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2182093943	1.0000 % BNG 1 06/03/30 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	83.44%	7'215'316.21	0.42	a)
XS2199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	1'000	0	0	1'000 EUR	74.81%	702'247.81	0.04	a)
XS2265251905	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	95.77%	910'964.04	0.05	a)
XS2343566662	0.8750 % BNG 0 7/8 05/18/26 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	94.81%	1'639'713.32	0.09	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384269366	0.7500 % HEIBOS 0 3/4 09/06/29 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2435603571	0.6250 % HEIBOS 0 5/8 07/24/25 EMTN	0	580	580	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2679898184	4.8750 % REWEEG 4 7/8 09/13/30	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2697483118	4.1250 % INTNED 4 1/8 10/02/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715940891	4.2200 % SDZSW 4.22 04/17/30	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	4'300	4'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	0	3'350	3'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2729201330	1.0530 % INTNED 1.053 12/07/28 EMTN	0	900'000	0	900'000 JPY	99.52%	5'084'488.74	0.29	a)
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	0	4'100	1'100	3'000 EUR	98.59%	2'776'651.01	0.16	a)
XS2770920184	1.2220 % RABOBK 1.222 02/26/30 EMTN	0	1'000'000	200'000	800'000 JPY	99.68%	4'526'993.35	0.26	a)
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	6'700	6'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2850439642	3.5000 % DSVDC 3 1/2 06/26/29 EMTN	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2886191589	4.2500 % INTNED 4 1/4 08/26/35 EMTN	0	4'400	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2900380812	3.3750 % DTRGR 3 3/8 09/23/30 EMTN	0	7'900	7'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2902720171	3.3600 % BPLN 3.36 09/12/31 EMTN	0	13'800	4'300	9'500 EUR	99.38%	8'862'646.93	0.51	a)
XS2908093805	3.8300 % HBRLN 3.83 10/03/29	0	10'000	4'000	6'000 EUR	99.58%	5'609'007.95	0.32	a)
XS2908095172	4.3570 % HBRLN 4.357 10/03/32	0	12'900	6'400	6'500 EUR	99.44%	6'067'943.60	0.35	a)
XS2919216122	4.0000 % NEDWBK 4 10/16/26 REGS	0	19'500	3'500	16'000 USD	99.50%	13'766'300.70	0.79	a)
NL							68'480'837.30	3.95	
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	10'000	35'000	0	45'000 NOK	87.63%	3'091'394.11	0.18	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	17'000	0	17'000 NOK	93.91%	1'251'471.81	0.07	a)
NO0013148338	3.6250 % NGB 3 5/8 04/13/34 487	0	30'000	0	30'000 NOK	98.31%	2'311'981.20	0.13	a)
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	92.31%	798'187.28	0.05	a)
US656531AG58	6.8000 % EQNR 6.8 01/15/28	1'500	0	0	1'500 USD	105.75%	1'371'578.49	0.08	a)
XS1188118100	2.1250 % KBN 2 1/8 02/11/25 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	99.29%	1'030'220.87	0.06	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	84.04%	726'667.94	0.04	a)
XS2465774474	2.6250 % DNBNO 2 5/8 06/10/26	2'300	0	0	2'300 GBP	98.45%	2'517'281.43	0.15	a)
XS2723597923	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/26 EMTN	0	5'100	5'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779793061	3.7500 % STATK 3 3/4 03/22/39 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2838545825	4.6250 % KBN 4 5/8 09/10/27 REGS	0	6'200	0	6'200 USD	100.94%	5'411'481.10	0.31	a)
NO							18'510'264.23	1.07	
AU3C80301240	4.7000 % NZLGFA 4.7 08/01/28 MTN	300	0	300	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
NZ1IBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	3'500	0	0	3'500 NZD	127.38%	2'294'376.04	0.13	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	2'650	0	0	2'650 USD	101.89%	2'334'717.67	0.13	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	94.37%	1'387'273.66	0.08	a)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	0	2'600	0	2'600 USD	84.47%	1'899'116.40	0.11	a)
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	86.54%	748'320.03	0.04	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	0	2'800	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1245411233	4.5000 % FCGNZ 4 1/2 07/17/25 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	101.50%	3'693'977.20	0.21	a)
XS1515173315	0.7500 % FCGNZ 0 3/4 11/08/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	99.97%	1'876'972.86	0.11	a)
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	84.04%	1'183'371.02	0.07	a)
XS2353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	1'000	0	0	1'000 EUR	90.35%	848'140.30	0.05	a)
XS2919279633	3.1850 % ASBBNK 3.185 04/16/29 EMTN	0	2'700	0	2'700 EUR	99.86%	2'530'973.17	0.15	a)
NZ							18'797'238.35	1.08	
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	1'500	1'000	1'200	1'300 USD	98.81%	1'110'778.06	0.06	a)
PE							1'110'778.06	0.06	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	7'000	0	0	7'000 PLN	91.92%	1'388'050.40	0.08	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	3'000	0	0	3'000 PLN	87.94%	569'133.20	0.03	a)
PL0000115291	6.0000 % POLGB 6 10/25/33 1033	0	10'000	0	10'000 PLN	100.63%	2'170'940.24	0.13	a)
XS2711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2778272471	4.0000 % BGOSK 4 03/13/32 EMTN	0	3'400	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2778274410	4.3750 % BGOSK 4 3/8 03/13/39 EMTN	0	5'600	5'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2831765099	4.3750 % BGOSK 4 3/8 06/11/54 EMTN	0	6'000	3'000	3'000 EUR	102.14%	2'876'656.97	0.17	a)
XS2851607403	5.7500 % BGOSK 5 3/4 07/09/34 REGS	0	5'900	5'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2851609102	6.2500 % BGOSK 6 1/4 07/09/54 REGS	0	6'000	2'000	4'000 USD	101.84%	3'522'545.68	0.20	a)
XS2902087423	3.8750 % BGOSK 3 7/8 03/13/35 EMTN	0	7'700	0	7'700 EUR	99.57%	7'197'142.61	0.41	a)
PL							17'724'469.10	1.02	
XS2357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
QA							0.00	0.00	
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	0	1'350	250	1'100 EUR	64.94%	670'634.17	0.04	a)
XS2770921315	5.6250 % ROMANI 5 5/8 02/22/36 REGS	0	3'370	3'370	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2829209720	5.2500 % ROMANI 5 1/4 05/30/32 REGS	0	6'500	2'000	4'500 EUR	99.75%	4'213'852.98	0.24	a)
RO							4'884'487.15	0.28	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000 SEK	114.76%	463'707.37	0.03	a)
US01021NAA00	4.2500 % SEK 4 1/4 02/01/29 GMTN	0	4'800	0	4'800 USD	99.66%	4'136'448.10	0.24	a)
US83051GAR92	0.8500 % SEB 0.85 09/02/25 144A	0	9'000	0	9'000 USD	96.96%	7'545'406.79	0.43	a)
US87031CAE30	2.2500 % SEK 2 1/4 03/22/27 GMTN	0	1'800	0	1'800 USD	95.30%	1'483'321.94	0.09	a)
USW8454EAT56	5.1250 % SEB 5 1/8 03/05/27 REGS	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	200'000	200'000 JPY	99.70%	1'131'918.64	0.07	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	4'000	0	4'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	0	8'700	0	8'700 EUR	72.08%	5'887'081.41	0.34	a)
XS2667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	2'750	0	2'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	102.41%	2'114'959.45	0.12	a)
XS2717300391	4.1250 % SWEDA 4 1/8 11/13/28 GMTN	0	4'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2748970402	3.7500 % LFBANK 3 3/4 01/17/29 EMTN	0	8'050	8'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2928674410	4.1250 % KOMINS 4 1/8 07/01/26 REGS	0	14'200	0	14'200 USD	99.71%	12'243'500.02	0.71	a)
XS2930111096	0.0000 % SHBASS 3 5/8 11/04/36 EMTN	0	2'450	0	2'450 EUR	98.93%	2'275'303.18	0.13	a)
XS2930571174	2.8750 % SWEDA 2 7/8 04/30/29 GMTN	0	7'300	0	7'300 EUR	98.81%	6'771'388.33	0.39	a)
SE							44'053'035.23	2.54	
AU3CB0302107	4.7530 % CLFCAP 4.753 08/31/28 MTN	2'000	0	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
HK0001051348	2.7500 % TEMASE 2 3/4 08/28/34 EMTN	0	33'290	0	33'290 CNY	100.71%	4'067'058.01	0.23	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	3'900	0	0	3'900 SGD	100.72%	2'567'574.64	0.15	a)
US23304SAC70	2.3750 % DBSSP 2 3/8 03/17/27 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	95.15%	2'879'727.70	0.17	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	8'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'500	3'650	5'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2463967369	4.5000 % UOBSP 4 1/2 04/06/32 GMTN	27'000	0	27'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
SG							9'514'360.35	0.55	
JP570500EQ92	0.7500 % SLOVEN 0 3/4 09/03/27 1	0	600'000	0	600'000 JPY	99.91%	3'403'044.77	0.20	a)
SI							3'403'044.77	0.20	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOSPO 5 3/8 10/04/28 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK4000024865	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 03/06/34 250	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK							0.00	0.00	
TH0623036C06	2.1250 % THAIGB 2 1/8 12/17/26	50'000	0	0	50'000 THB	100.04%	1'281'726.68	0.07	a)
TH0623031602	3.3000 % THAIGB 3.3 06/17/38	30'000	0	0	30'000 THB	107.42%	825'791.80	0.05	a)
TH062303M604	2.0000 % THAIGB 2 06/17/42	20'000	0	0	20'000 THB	89.00%	456'121.94	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
TH0623A3C606	3.7750 % THAIGB 3.775 06/25/32	30'000	0	0	30'000 THB	109.95%	845'256.20	0.05	a)
TH0623X3BC03	2.0000 % THAIGB 2 12/17/31	0	50'000	0	50'000 THB	98.05%	1'256'230.26	0.07	a)
USY06072AH89	5.6500 % BBLTB 5.65 07/05/34 REGS	0	5'400	5'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
TH							4'665'126.88	0.27	
AU3CB0278885	3.8500 % VZ 3.85 03/23/41 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	72.18%	408'806.34	0.02	a)
HK0001051538	3.2500 % PLD 3 1/4 09/11/29	0	42'000	0	42'000 CNY	100.14%	5'102'019.40	0.29	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BJ41	4.7500 % APD 4 3/4 02/08/31	0	9'500	9'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BK14	4.8500 % APD 4.85 02/08/34	0	5'800	5'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DP17	5.0980 % AXP 5.098 02/16/28	0	2'225	2'225	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	3'600	3'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DV84	5.0430 % AXP 5.043 07/26/28	0	3'150	3'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	0	5'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04685A3B58	5.9192 % ATH FLOAT 08/19/24 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04686E3F70	0.9140 % ATH 0.914 08/19/24 REGS	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04686E3H37	1.9850 % ATH 1.985 08/19/28 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	0	4'500	0	4'500 USD	90.66%	3'527'872.24	0.20	a)
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	6'000	0	4'000	2'000 USD	101.77%	1'760'062.26	0.10	a)
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	4'000	0	0	4'000 USD	100.81%	3'486'885.46	0.20	a)
US09290DAH44	4.6000 % BLK 4.6 07/26/27	0	4'300	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09290DAK72	5.3500 % BLK 5.35 01/08/55	0	7'000	5'500	1'500 USD	100.12%	1'298'645.37	0.07	a)
US110122DQ80	1.4500 % BMY 1.45 11/13/30	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EH72	5.2000 % BMY 5.2 02/22/34	0	2'840	2'840	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EK02	5.5500 % BMY 5.55 02/22/54	0	1'960	1'960	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EL84	5.6500 % BMY 5.65 02/22/64	0	2'400	500	1'900 USD	100.55%	1'651'966.12	0.10	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	0	2'500	0	2'500 USD	88.76%	1'918'747.68	0.11	a)
US172967MQ12	3.1060 % C 3.106 04/08/26	0	2'000	0	2'000 USD	99.14%	1'714'527.16	0.10	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	2'500	700	0	3'200 USD	94.86%	2'624'814.14	0.15	a)
US17325FBB31	5.8030 % C 5.803 09/29/28	5'500	0	3'500	2'000 USD	103.84%	1'795'791.67	0.10	a)
US17325FBJ66	4.9290 % C 4.929 08/06/26	0	4'750	0	4'750 USD	100.62%	4'132'749.34	0.24	a)
US17325FBK30	4.8380 % C 4.838 08/06/29	0	4'325	0	4'325 USD	100.31%	3'751'420.97	0.22	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US191216DT43	5.4000 % KO 5.4 05/13/64	0	1'450	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	1'180	0	1'180	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8W51	5.5500 % META 5.55 08/15/64	0	1'050	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAT70	5.9500 % GM 5.95 04/01/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEQ51	5.4000 % GM 5.4 05/08/27	0	1'300	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XER35	5.7500 % GM 5 3/4 02/08/31	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GB607	4.6920 % GS 4.692 10/23/30	0	1'990	0	1'990 USD	98.76%	1'699'329.63	0.10	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38151LAG59	5.4140 % GS 5.414 05/21/27	0	5'800	1'800	4'000 USD	100.94%	3'491'278.13	0.20	a)
US41283LBB09	5.9500 % HOG 5.95 06/11/29 144A	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076CJ91	1.8750 % HD 1 7/8 09/15/31	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891ABY29	1.0000 % HYNMTR 1 09/17/24 144A	0	10'720	10'720	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	90.02%	1'323'255.60	0.08	a)
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	2'650	0	2'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CDC47	5.3000 % HYNMTR 5.3 06/24/29 REGS	0	7'400	1'900	5'500 USD	100.75%	4'791'281.08	0.28	a)
US458140BK55	3.1000 % INTC 3.1 02/15/60	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJY71	3.8750 % JPM 3 7/8 09/10/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	3'100	600	2'500 USD	87.36%	1'888'461.57	0.11	a)
US46647PEA03	5.0400 % JPM 5.04 01/23/28	0	1'100	0	1'100 USD	100.52%	956'144.62	0.06	a)
US46647PEL67	4.9790 % JPM 4.979 07/22/28	0	6'550	1'550	5'000 USD	100.48%	4'344'252.80	0.25	a)
US501044DW87	5.5000 % KR 5 1/2 09/15/54	0	4'150	4'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US501044DX60	5.6500 % KR 5.65 09/15/64	0	4'600	4'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BZ08	2.5000 % LLY 2 1/2 09/15/60	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EF07	4.4500 % LOW 4.45 04/01/62	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629W3S73	4.3500 % MASSMU 4.35 09/17/31 144A	0	17'000	13'000	4'000 USD	96.78%	3'347'495.82	0.19	a)
US57629W4S64	5.1000 % MASSMU 5.1 04/09/27 144A	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629W5B21	4.8500 % MASSMU 4.85 01/17/29 144A	0	12'000	9'000	3'000 USD	100.75%	2'613'659.51	0.15	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	0	1'650	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	0	1'350	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBG98	2.9000 % MRK 2.9 12/10/61	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58989V2H68	5.2500 % MET 5 1/4 04/12/29 144A	0	1'500	0	1'500 USD	101.83%	1'320'824.93	0.08	a)
US58989V2J25	4.0000 % MET 4 10/01/27 144A	0	4'750	3'250	1'500 USD	98.56%	1'278'346.54	0.07	a)
US594918CF95	3.0410 % MSFT 3.041 03/17/62	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U8A11	4.9520 % MS 4.952 01/14/28 BKNT	0	3'000	0	3'000 USD	100.42%	2'605'073.04	0.15	a)
US61690U8G80	4.4470 % MS 4.447 10/15/27	0	6'000	0	6'000 USD	99.49%	5'161'532.65	0.30	a)
US6174468G77	4.4310 % MS 4.431 01/23/30 GMTN	0	3'000	0	3'000 USD	98.02%	2'542'814.64	0.15	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	1'575	0	1'575	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US637639AM77	4.9000 % NSCCLF 4.9 06/26/29 144A	0	5'250	0	5'250 USD	101.06%	4'587'704.76	0.26	a)
US64952WJF71	3.9000 % NYLIFE 3.9 10/01/27 144A	0	9'750	7'750	2'000 USD	98.36%	1'701'072.43	0.10	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US682680BN20	6.6250 % OKE 6 5/8 09/01/53	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US682680CF86	5.7000 % OKE 5.7 11/01/54	0	12'000	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US682680CG69	5.8500 % OKE 5.85 11/01/64	0	13'000	11'200	1'800 USD	96.05%	1'494'995.39	0.09	a)
US74256LFA26	4.6000 % PFG 4.6 08/19/27 144A	0	1'080	1'080	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74350LAC81	5.2500 % PROTAR 5 1/4 01/15/35 144A	0	2'470	2'470	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LBF67	4.6250 % DGX 4 5/8 12/15/29	0	3'450	3'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109CQ54	5.3750 % O 5 3/8 09/01/54	0	1'100	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBH86	7.6600 % SANUSA 7.66 11/09/31	0	3'400	3'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBK16	6.1240 % SANUSA 6.124 05/31/27	0	2'464	2'464	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBM71	5.3530 % SANUSA 5.353 09/06/30	0	7'250	7'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	3'700	0	3'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US857477CN16	4.5300 % STT 4.53 02/20/29	0	4'560	1'660	2'900 USD	99.24%	2'488'672.32	0.14	a)
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	0	3'800	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797HT78	0.0000 % B 06/06/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797JA69	0.0000 % B 01/23/24	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	5'000	0	0	5'000 USD	90.72%	3'922'225.16	0.23	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	17'000	13'000	7'000	23'000 USD	81.17%	16'143'543.67	0.93	a)
US912810RA88	0.6250 % TII 0 5/8 02/15/43	0	5'000	0	5'000 USD	105.51%	4'561'565.54	0.26	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	33'000	15'000	10'000	38'000 USD	78.45%	25'778'598.53	1.49	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	11'000	0	0	11'000 USD	80.55%	7'661'377.11	0.44	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	0	3'500	0	3'500 USD	76.73%	2'322'327.50	0.13	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	3'000	0	0	3'000 USD	76.48%	1'984'081.17	0.11	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	4'000	0	0	4'000 USD	76.28%	2'638'415.88	0.15	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	5'000	40'000	0	45'000 USD	50.23%	19'546'948.83	1.13	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	15'000	7'000	0	22'000 USD	51.70%	9'835'692.28	0.57	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	14'000	0	0	14'000 USD	62.39%	7'552'884.28	0.44	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	2'500	0	0	2'500 USD	58.92%	1'273'743.64	0.07	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	18'000	4'000	0	22'000 USD	69.41%	13'203'428.56	0.76	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	8'000	0	0	8'000 USD	60.55%	4'188'390.63	0.24	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	0	4'000	0	4'000 USD	67.08%	2'320'098.19	0.13	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	26'000	16'500	7'500	35'000 USD	58.53%	17'714'190.16	1.02	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	14'000	11'000	9'000	16'000 USD	64.20%	8'882'630.75	0.51	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	0	8'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	8'500	13'500	9'000	13'000 USD	90.87%	10'214'837.36	0.59	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	0	14'700	14'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	11'000	0	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283R96	0.5000 % TII 0 1/2 01/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	122.41%	1'058'501.92	0.06	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V491	0.3750 % TII 0 3/8 01/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	126.06%	2'180'071.28	0.13	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	7'000	7'000	14'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	0	37'000	37'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	0	4'170	4'170	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	0	8'000	5'000	3'000 USD	99.20%	2'573'428.27	0.15	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZZ63	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/30	1'500	0	0	1'500 USD	111.99%	1'452'565.47	0.08	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	0	22'000	18'500	3'500 USD	82.55%	2'498'476.35	0.14	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	5'970	0	5'970	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	0	18'000	18'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	0	15'000	5'000	10'000 USD	83.32%	7'204'707.47	0.42	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	0	8'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCA71	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	116.60%	2'016'413.26	0.12	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	0	20'000	20'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCM10	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/31	0	7'000	0	7'000 USD	105.04%	6'358'174.95	0.37	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	0	31'700	31'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	0	20'000	20'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	0	12'000	9'000	3'000 USD	99.28%	2'575'454.91	0.15	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	8'000	11'000	11'000	8'000 USD	85.25%	5'897'254.00	0.34	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFG15	3.2500 % T 3 1/4 08/31/24	0	12'000	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	0	14'000	11'000	3'000 USD	99.55%	2'582'345.48	0.15	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	8'000	0	8'000 USD	93.69%	6'480'926.50	0.37	a)
US91282CHP95	1.3750 % TII 1 3/8 07/15/33	2'000	5'000	5'000	2'000 USD	99.19%	1'715'327.49	0.10	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	19'000	9'000	10'000 USD	97.86%	8'461'900.16	0.49	a)
US91324PCQ37	4.6250 % UNH 4 5/8 07/15/35	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEA66	3.1250 % UNH 3 1/8 05/15/60	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFD96	5.5000 % UNH 5 1/2 04/15/64	0	8'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFM95	5.7500 % UNH 5 3/4 07/15/64	0	2'640	2'640	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGN82	2.3550 % VZ 2.355 03/15/32	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGW81	5.5000 % VZ 5 1/2 02/23/54	0	1'850	1'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94988J6D46	5.4500 % WFC 5.45 08/07/26 BKNT	5'250	0	2'250	3'000 USD	101.50%	2'632'907.74	0.15	a)
USQ6684MAB92	5.7500 % NEM 5 3/4 11/15/41 REGS	0	4'010	4'010	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU09513KC24	4.6000 % BMW 4.6 08/13/27 REGS	0	5'930	2'930	3'000 USD	99.78%	2'588'263.28	0.15	a)
USU09513KE89	4.8500 % BMW 4.85 08/13/31 REGS	0	1'050	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU3822UAA89	5.0000 % HWQCUS 5 07/27/28 REGS	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	0	1'200	0	1'200 USD	95.57%	991'620.67	0.06	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	0	1'950	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	1'600	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USU8344PAE98	5.6500 % SYENS 5.65 06/04/29 REGS	0	7'000	2'500	4'500 USD	102.28%	3'979'712.57	0.23	a)
XS1323463726	1.6250 % UPS 1 5/8 11/15/25	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	300'000	0	0	300'000 JPY	98.78%	1'682'210.32	0.10	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	500'000	0	0	500'000 JPY	99.68%	2'829'370.85	0.16	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	200'000	800'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1645684157	0.2980 % WMT 0.298 07/18/24	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	0	100'000 JPY	98.65%	559'976.10	0.03	a)
XS1659697665	0.6980 % GLW 0.698 08/09/24	250'000	0	250'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1762729538	4.6500 % C 4.65 06/12/24 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2045001935	2.4500 % C 2.45 09/30/25 EMTN	1'500	1'806	0	3'306 USD	97.63%	2'791'061.40	0.16	a)
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	0	850	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056488013	2.0000 % TOYOTA 2 10/22/26 EMTN	2'700	0	0	2'700 USD	94.60%	2'208'546.70	0.13	a)
XS2079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193854804	0.8500 % PLD 0.85 06/24/30	300'000	0	0	300'000 JPY	95.19%	1'621'157.63	0.09	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	1'500	950	0	2'450 EUR	85.90%	1'975'756.56	0.11	a)
XS2330256236	0.6330 % AFL 0.633 04/15/31	0	550'000	0	550'000 JPY	94.72%	2'957'448.10	0.17	a)
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	0	800	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404272572	0.1100 % PG 0.11 11/06/26	0	100'000	0	100'000 JPY	98.96%	561'747.22	0.03	a)
XS2410427079	4.0600 % C 4.06 03/28/24 GMTN	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.31%	894'712.11	0.05	a)
XS2548076053	0.8530 % TMO 0.853 10/20/25	300'000	0	0	300'000 JPY	99.68%	1'697'605.48	0.10	a)
XS2548076301	1.0540 % TMO 1.054 10/20/27	300'000	200'000	0	500'000 JPY	98.91%	2'807'260.18	0.16	a)
XS2597740476	4.1090 % NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634234020	0.8130 % PYPL 0.813 06/09/25	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	360'000	0	0	360'000 JPY	100.04%	2'044'320.06	0.12	a)
XS2634234376	1.2400 % PYPL 1.24 06/09/28	230'000	0	0	230'000 JPY	99.64%	1'300'923.05	0.07	a)
XS2731506841	3.7500 % MET 3 3/4 12/07/31 GMTN	0	5'450	5'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2747270630	3.9000 % GM 3.9 01/12/28 EMTN	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2747557416	4.8750 % SKBTAM 4 7/8 01/23/27	0	2'200	0	2'200 USD	100.01%	1'902'549.26	0.11	a)
XS2753287585	4.8750 % SKBTAM 4 7/8 01/23/27	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2776511730	3.6250 % BKNG 3 5/8 03/01/32	0	5'400	5'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2790333707	3.7900 % MS 3.79 03/21/30	0	3'700	1'700	2'000 EUR	101.71%	1'909'622.89	0.11	a)
XS2790333889	3.9550 % MS 3.955 03/21/35 EMTN	0	5'200	1'400	3'800 EUR	101.56%	3'622'789.87	0.21	a)
XS2791972248	3.7610 % JPM 3.761 03/21/34 EMTN	0	4'700	0	4'700 EUR	101.26%	4'467'935.52	0.26	a)
XS2865533462	3.9000 % WFC 3.9 07/22/32 EMTN	0	4'350	1'350	3'000 EUR	101.42%	2'856'323.45	0.16	a)
XS2866190965	3.6500 % HND 3.65 04/23/31 EMTN	0	9'600	9'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2892944732	3.3750 % SYK 3 3/8 09/11/32	0	5'300	5'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2892950622	5.0000 % O 5 10/15/29	0	2'300	2'300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2892952917	5.2500 % O 5 1/4 09/04/41	0	1'300	1'300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
US							344'494'851.37	19.86	
AU3CB0230134	4.5000 % CAF 4 1/2 06/05/25 MTN	1'094	0	0	1'094 AUD	99.39%	615'838.41	0.04	a)
VE							615'838.41	0.04	
AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	715	0	715	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0295764	4.7500 % EIB 4 3/4 01/20/33	1'300	0	1'300	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0306678	5.3000 % CAF 5.3 02/19/29 MTN	0	9'000	1'000	8'000 AUD	99.18%	4'493'873.57	0.26	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	3'000	0	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	7'500	0	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	1'000	0	1'000 EUR	101.15%	949'591.95	0.05	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	3'000	1'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KSXE1	0.0000 % EU 0 07/04/31 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	2'000	0	0	2'000 EUR	55.24%	1'037'121.80	0.06	a)
JP500113AL71	0.7700 % CAF 0.77 07/30/25 14	100'000	0	0	100'000 JPY	99.90%	567'094.66	0.03	a)
US008281BF39	5.7500 % AFDB 5 3/4 PERP	0	8'700	1'700	7'000 USD	96.52%	5'841'956.44	0.34	a)
US00828EFD67	3.5000 % AFDB 3 1/2 09/18/29	0	18'000	4'000	14'000 USD	96.78%	11'716'477.47	0.68	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US045167GE77	4.8750 % ASIA 4 7/8 05/21/26 GMTN	0	11'600	11'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04522KAA43	2.2500 % AIB 2 1/4 05/16/24	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15238RAJ14	5.0000 % CABEL 5 01/25/27 REGS	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29874QAY08	1.6250 % EBRD 1 5/8 09/27/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785HM16	2.3750 % EIB 2 3/8 05/24/27	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785HT68	3.1250 % EIB 3 1/8 12/14/23 GMTN	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JA59	1.6250 % EIB 1 5/8 10/09/29	0	5'000	0	5'000 USD	88.62%	3'831'269.53	0.22	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	0	3'110	3'110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JS67	2.7500 % EIB 2 3/4 08/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JT41	3.2500 % EIB 3 1/4 11/15/27	0	1'650	0	1'650 USD	97.42%	1'389'887.65	0.08	a)
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	0	1'000	0	1'000 USD	89.88%	777'201.01	0.04	a)
US4581X0EN43	4.1250 % IADB 4 1/8 02/15/29	0	11'900	4'900	7'000 USD	99.66%	6'032'562.26	0.35	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	2'500	0	0	2'500 USD	83.91%	1'813'859.57	0.10	a)
US459058KJ14	3.1250 % IBRD 3 1/8 06/15/27	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45906M5K36	4.7500 % IBRD 4 3/4 07/30/29 GDIF	0	17'000	0	17'000 USD	99.78%	14'667'707.22	0.85	a)
US45950KDH05	4.2500 % IFC 4 1/4 07/02/29 GMTN	0	11'800	0	11'800 USD	100.18%	10'221'826.23	0.59	a)
US45950VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	1'250	0	0	1'250 USD	96.96%	1'048'048.83	0.06	a)
XS0070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	170'000	270'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0876282137	0.0000 % EIB 0 01/18/33 GDIF	10'000	0	0	10'000 JPY	93.21%	52'911.77	0.00	a)
XS1003743827	3.3100 % CAF 3.31 12/12/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	99.45%	1'867'172.22	0.11	a)
XS1225179420	1.9500 % IBRD 1.95 05/08/25 GDIF	0	10'000	0	10'000 USD	98.37%	8'506'313.31	0.49	a)
XS1562584158	0.0000 % AFDB 0 02/09/32 GDIF	0	100'000	0	100'000 MXN	50.94%	2'198'390.72	0.13	a)
XS1751359016	1.3750 % EIB 1 3/8 05/12/28 EMTN	20'000	0	15'000	5'000 SEK	96.41%	389'553.63	0.02	a)
XS1757690992	5.7500 % EIB 5 3/4 01/24/25 REGS	10'000'000	0	0	10'000'000 IDR	99.76%	549'577.84	0.03	a)
XS1789715064	8.5000 % CAF 8 1/2 03/08/28 EMTN	50'000	0	0	50'000 MXN	92.99%	2'006'491.70	0.12	a)
XS1821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	0	13'000'000	0	13'000'000 COP	88.95%	2'265'701.25	0.13	a)
XS1984477650	9.6000 % CAF 9.6 05/03/39	0	170'000	0	170'000 MXN	82.73%	6'069'395.17	0.35	a)
XS2045838039	6.4748 % CABEL FLOAT 11/15/24 EMTN	3'305	0	0	3'305 USD	100.02%	2'858'433.65	0.16	a)
XS2288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	12'000	0	0	12'000 CNY	99.98%	1'455'390.62	0.08	a)
XS2289410420	0.2000 % IBRD 0.2 01/21/61	2'000	0	0	2'000 EUR	40.38%	758'216.60	0.04	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
XS2290963466	0.0500 % EIB 0.05 01/27/51	2'000	0	0	2'000 EUR	46.75%	877'701.81	0.05	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2296644094	4.2500 % EBRD 4 1/4 02/07/28 EMTN	20'000'000	50'000'000	0	70'000'000 IDR	94.08%	3'628'007.04	0.21	a)
XS2311552363	5.0000 % AIB 5 03/05/26 GMTN	30'000	0	30'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
XS2318315921	2.5000 % AIB 2 1/2 03/24/25 GMTN	10'000	10'030	20'030	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	40'000	38'000	78'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	0	55'000	20'000	35'000 CNY	100.88%	4'283'272.71	0.25	a)
XS2406749478	5.1000 % IADB 5.1 11/17/26 EMTN	20'000'000	0	0	20'000'000 IDR	97.52%	1'074'508.41	0.06	a)
XS2437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	0	90'000	80'000	10'000 CNY	100.16%	1'215'106.20	0.07	a)
XS2457458854	3.0500 % IBRD 3.05 03/16/24 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	0	37'500	35'000	2'500 CNY	102.85%	311'922.71	0.02	a)
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	4'900	0	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	101.03%	2'451'296.58	0.14	a)
XS2547546098	5.9000 % CAF 5.9 10/19/37 EMTN	0	6'000	0	6'000 AUD	96.16%	3'267'709.43	0.19	a)
XS2574388562	6.0000 % EBRD 6 01/17/30 GMTN	30'000'000	10'000'000	0	40'000'000 IDR	98.00%	2'159'461.89	0.12	a)
XS2577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	20'000	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2594907664	4.5000 % CAF 4 1/2 03/07/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	60'000	160'000	40'000	180'000 CNY	100.55%	21'956'418.15	1.27	a)
XS2749537481	3.2000 % IDAWBG 3.2 01/18/44 GMTN	0	5'500	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2758114164	4.6250 % OFIDEV 4 5/8 02/08/27 REGS	0	2'800	0	2'800 USD	99.96%	2'420'143.11	0.14	a)
XS2868924189	2.7500 % IBRD 2 3/4 07/26/34 EMTN	0	55'000	0	55'000 CNY	100.50%	6'705'636.16	0.39	a)

XS

143'717'210.87 8.29

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

0.00 0.00

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

0.00 0.00

CH0215801199 SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLBL AGGRT NT CHF

0 362'219 362'219 0 CHF 0.00 0.00 0.00

CH

0.00 0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente							2'532'899.75	0.15	
Futures							0.00	0.00	
12/23	EURO-SCHATZ FUT DEC23	100	0	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	-70	70	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BTP FUTURE DEC23	0	80	80	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	170	30	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	130	0	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	US LONG BOND(CBT) DEC23	-10	10	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	70	180	250	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	100	0	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	50	0	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	255	255	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	130	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-SCHATZ FUT MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	AUST 10Y BOND FUT MAR24	0	70	70	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR ULTRA FUT MAR24	0	290	290	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	190	190	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	CAN 10YR BOND FUT MAR24	0	100	100	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 2YR NOTE (CBT) MAR24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	260	260	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	240	240	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-SCHATZ FUT JUN24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	175	175	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	40	40	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US ULTRA BOND CBT JUN24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	185	185	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	80	80	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 5YR NOTE (CBT) JUN24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 2YR NOTE (CBT) JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	420	420	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BOBL FUTURE SEP24	0	280	280	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-SCHATZ FUT SEP24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUXL 30Y BND SEP24	0	75	75	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-OAT FUTURE SEP24	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	AUST 10Y BOND FUT SEP24	0	140	140	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
09/24	US 10YR ULTRA FUT SEP24	0	190	190	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	US ULTRA BOND CBT SEP24	0	125	125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	JPN 10Y BOND(OSE) SEP24	0	12	12	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/24	LONG GILT FUTURE SEP24	0	160	160	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/24	US 5YR NOTE (CBT) SEP24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/24	EURO-BUND FUTURE DEC24	0	210	70	140 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	EURO-BOBL FUTURE DEC24	0	130	30	100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	EURO-BUXL 30Y BND DEC24	0	15	35	-20 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	US 10YR ULTRA FUT DEC24	0	290	290	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/24	US ULTRA BOND CBT DEC24	0	35	110	-75 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	JPN 10Y BOND(OSE) DEC24	0	0	12	-12 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	LONG GILT FUTURE DEC24	0	110	20	90 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
12/24	US 5YR NOTE (CBT) DEC24	0	260	510	-250 USD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte									
	CHF/EUR Verfall 13.11.2023		6'180'000	5'939'394	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 13.11.2023		1'470'000	1'623'056	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 13.11.2023		17'500'000	2'160'638	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.11.2023		557'430'000	3'323'364	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.11.2023		17'000'000	15'281'555	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.11.2023		2'000'000	2'076'908	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.04.2024		1'885'080	15'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 23.07.2024		1'500'000	182'390	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		3'800'000	3'230'308	USD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.10.2024		1'254'624	29'000'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	CAD/CHF Verfall 30.11.2023		14'927'951	22'700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		21'789'669	19'950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.11.2023		1'504'042	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.11.2023		1'316'448	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		128'546'203	135'340'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		264'326'657	294'860'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.11.2023		7'999'740	14'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		48'738'726	397'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 30.11.2023		450'857	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.11.2023		1'441'179	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		65'284'865	10'830'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.11.2023		2'470'000	2'209'882		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.11.2023		690'000	654'544		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.11.2023		2'460'000	2'185'211		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.11.2023		150'000	161'547		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		1'336'196	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		2'465'780	19'940'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		6'230'991	6'490'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		1'058'578	176'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		582'078	530'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		12'128'983	13'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		11'571'711	12'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		2'285'884	18'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		1'317'372	1'190'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		2'617'633	434'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		4'385'525	4'560'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		3'217'484	3'590'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 30.11.2023		3'770'000	465'388		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.11.2023		1'645'057	2'530'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.11.2023		1'030'618	1'790'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		2'342'320	19'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		1'344'496	1'220'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		6'764'637	7'040'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		3'055'287	512'150'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		14'451'121	16'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		12'815'699	14'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		7'032'937	7'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		1'554'187	12'560'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		1'534'485	1'390'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		3'787'369	635'980'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		1'149'631	1'290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		935'238	157'930'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		1'100'574	9'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		2'275'370	2'360'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		2'142'320	2'420'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		1'002'141	910'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		1'321'614	1'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.11.2023		1'036'313	1'790'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.11.2023		1'493'405	2'320'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		508'170	460'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		743'725	125'450'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 01.12.2023		2'218'632	39'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 01.12.2023		4'320'568	6'500'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 01.12.2023		1'226'213	1'800'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 01.12.2023		8'300'000'000	5'642'700		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 01.12.2023		39'000'000'000	2'224'136		IDR/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.01.2024		1'350'640	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.01.2024		1'530'542	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		10'220'010	17'580'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		17'740'602	27'550'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 11.01.2024		452'007	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		76'622'417	12'872'460'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		58'040'371	472'730'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		28'281'999	25'500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		156'208'338	162'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.01.2024		1'469'549	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		313'978'516	359'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'240'093	1'420'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		2'278'880	2'420'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		3'297'488	3'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		2'859'913	3'040'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'183'989	1'360'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		1'697'054	278'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		4'564'560	5'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		1'494'192	12'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		1'686'388	1'780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		1'008'339	920'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.01.2024		4'022'863	33'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		1'218'502	1'890'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		8'846'972	9'380'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.01.2024		5'131'811	854'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		19'472'436	22'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		2'012'111	2'140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'908'176	3'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		3'380'000	2'880'852		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		2'980'551	3'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		1'149'217	1'800'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		1'689'988	1'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 12.01.2024		5'830'528	8'600'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 12.01.2024		2'491'168	44'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 12.01.2024		44'000'000'000	2'402'127		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 12.01.2024		8'600'000'000	5'507'747		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.02.2024		19'791'040	31'240'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.02.2024		358'100'760	422'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.02.2024		87'279'290	14'750'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.02.2024		29'814'746	27'650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.02.2024		1'482'135	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.02.2024		173'710'742	187'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 21.02.2024		1'323'952	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.02.2024		65'718'105	555'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.02.2024		9'984'579	17'580'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.02.2024		1'444'157	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 21.02.2024		450'225	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.02.2024		1'459'858	2'300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.02.2024		1'079'810	1'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.02.2024		2'225'006	18'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.02.2024		1'132'853	1'780'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.02.2024		3'694'053	31'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.02.2024		7'565'724	8'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.02.2024		3'171'991	3'380'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.02.2024		2'284'331	390'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.02.2024		1'497'328	1'380'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.02.2024		5'073'206	863'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.02.2024		2'089'907	42'000'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.02.2024		18'503'609	21'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.02.2024		5'695'015	6'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		3'900'000	3'378'071		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.02.2024		7'379'377	8'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.02.2024		2'171'039	2'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.02.2024		1'939'040	16'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		700'000	605'441		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.02.2024		1'304'750	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.02.2024		2'706'666	2'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		2'600'000	2'273'791		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.02.2024		203'880'000	193'645'224		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.02.2024		71'050'000	3'673'484		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.02.2024		17'580'000	10'135'749		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.02.2024		60'920'000	1'491'992		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.02.2024		5'500'000	462'165		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.02.2024		16'000'000	1'354'720		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.02.2024		30'030'000	33'342'309		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.02.2024		620'600'000	75'899'380		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.02.2024		35'320'000	23'088'331		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.02.2024		16'003'000'000	94'000'022		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		452'970'000	399'560'307		USD/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 22.02.2024		2'874'187	53'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.02.2024		5'940'586	9'300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.02.2024		9'300'000'000	6'110'345		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 22.02.2024		53'000'000'000	2'987'514		IDR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		191'920'995	202'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.03.2024		3'640'375	71'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.03.2024		10'110'785	17'580'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	THB/CHF Verfall 25.03.2024		1'487'532	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.03.2024		1'351'792	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.03.2024		460'917	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.03.2024		33'233'570	30'030'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.03.2024		75'761'607	620'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.03.2024		23'018'256	35'320'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.03.2024		94'152'370	16'003'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		391'174'135	445'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		6'400'000	781'875		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		2'700'000	2'564'811		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.03.2024		467'800'000	2'746'122		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		3'100'000	2'720'479		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		5'100'000	623'261		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		1'600'000	1'521'379		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		3'600'000	3'161'963		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		1'492'564	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		1'438'167	1'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		1'586'416	1'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		2'014'228	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		4'392'080	5'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.03.2024		2'207'485	3'800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.03.2024		4'645'582	37'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.03.2024		4'891'322	824'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		9'156'613	9'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		14'519'888	16'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		463'200'000	416'551'128		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.03.2024		16'000'000	1'375'200		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.03.2024		71'050'000	3'816'195		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		646'900'000	80'539'050		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.03.2024		5'500'000	463'155		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.03.2024		21'380'000	12'630'449		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		211'300'000	206'366'145		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.03.2024		30'030'000	34'207'173		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.03.2024		16'359'200'000	97'047'682		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.03.2024		35'320'000	23'462'016		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.03.2024		60'920'000	1'519'406		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.03.2024		6'750'455	10'300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.03.2024		2'968'522	53'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.03.2024		10'300'000'000	6'887'614		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.03.2024		53'000'000'000	3'036'466		IDR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.04.2024		412'913'893	460'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 24.04.2024		1'372'256	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 24.04.2024		3'784'933	71'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 24.04.2024		78'466'743	631'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.04.2024		12'598'806	21'380'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 24.04.2024		461'956	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.04.2024		205'918'189	211'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.04.2024		34'098'314	30'030'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 24.04.2024		97'168'577	16'359'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.04.2024		23'393'531	35'320'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 24.04.2024		1'516'037	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 24.04.2024		254'800'000	1'512'419		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 24.04.2024		2'100'000	2'046'477		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2024		3'600'000	3'225'982		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 24.04.2024		3'675'385	68'400'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 24.04.2024		2'317'331	27'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.04.2024		9'223'373	13'900'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.04.2024		13'300'654	11'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 24.04.2024		2'976'356	35'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.04.2024		6'888'796	11'700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 24.04.2024		32'940'818	5'523'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 24.04.2024		25'898'299	208'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.04.2024		138'173'841	153'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.04.2024		67'157'194	68'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2024		3'500'000	3'161'533		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 24.04.2024		664'200'000	3'986'130		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2024		2'300'000	2'085'504		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 24.04.2024		11'300'000	957'415		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 24.04.2024		3'800'000	2'274'224		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 24.04.2024		41'800'000	2'300'095		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 24.04.2024		900'000	1'018'254		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2024		7'300'000	6'632'262		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 24.04.2024		700'000	462'405		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 24.04.2024		48'520'000	32'215'824		CAD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/CNY	Verfall 24.04.2024		839'800'000	105'554'462		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 24.04.2024		97'650'000	5'190'361		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 24.04.2024		43'200'000	3'606'768		SEK/CHF	0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 24.04.2024		60'920'000	1'500'581		THB/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 24.04.2024		29'280'000	17'172'134		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 24.04.2024		29'700'000	2'452'329		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.04.2024		20'963'300'000	123'469'644		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.04.2024		278'000'000	269'673'900		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.04.2024		40'830'000	45'883'121		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.04.2024		597'700'000	544'654'125		USD/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 25.04.2024		6'871'303	10'300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 25.04.2024		3'018'825	53'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 25.04.2024		2'694'231	4'040'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 25.04.2024		14'340'000'000	9'475'047		KRW/CHF	0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 25.04.2024		53'000'000'000	2'971'868		IDR/CHF	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.06.2024		32'052'195	48'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 11.06.2024		5'121'323	97'650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 11.06.2024		1'493'688	60'900'000		CHF/THB	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 11.06.2024		3'594'888	43'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.06.2024		17'103'531	29'280'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 11.06.2024		2'441'964	29'700'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		268'742'322	278'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.06.2024		123'684'122	20'960'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.06.2024		45'615'338	40'800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		541'733'165	597'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.06.2024		1'300'000	1'267'505		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.06.2024		1'800'000	1'639'730		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.06.2024		430'000'000	2'534'708		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.06.2024		1'200'000	1'362'846		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 11.06.2024		500'000	332'613		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.06.2024		1'400'000	1'365'710		EUR/CHF	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 11.06.2024		866'901	10'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.06.2024		2'868'869	492'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		5'269'033	5'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.06.2024		1'490'005	2'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.06.2024		1'708'682	1'500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		3'896'768	4'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 11.06.2024		1'672'236	68'100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 11.06.2024		1'959'611	37'100'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		4'784'692	5'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		2'768'203	2'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		3'821'605	4'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		21'980'228	24'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.06.2024		5'957'712	48'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.06.2024		7'781'540	1'352'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		4'503'901	4'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.06.2024		820'600'000	4'698'427		JPY/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		3'843'645	4'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 11.06.2024		48'000'000	5'883'317		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 11.06.2024		844'300'000	104'211'949		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 11.06.2024		48'000'000	31'323'360		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 11.06.2024		21'553'800'000	123'216'608		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 11.06.2024		286'700'000	277'912'645		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 11.06.2024		41'100'000	46'876'194		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 11.06.2024		134'750'000	6'586'540		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.06.2024		639'900'000	573'708'744		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 11.06.2024		43'200'000	3'678'480		SEK/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 11.06.2024		40'200'000	3'373'182		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 11.06.2024		129'000'000	3'168'756		THB/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 11.06.2024		31'780'000	18'786'366		AUD/CHF	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 12.06.2024		104'500'250	835'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 12.06.2024		1'167'857	9'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 12.06.2024		9'446'491	14'340'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 12.06.2024		4'057'381	73'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 12.06.2024		754'689	1'150'900'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 12.06.2024		1'125'567	20'198'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 12.06.2024		15'490'900'000	10'080'995		KRW/CHF	0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 12.06.2024		93'198'300'000	5'113'369		IDR/CHF	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 25.07.2024		5'874'192	48'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 25.07.2024		104'043'089	844'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 25.07.2024		281'234'913	291'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 25.07.2024		50'168'856	44'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 25.07.2024		31'195'104	48'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 25.07.2024		6'507'711	134'750'000		CHF/MXN	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 25.07.2024		127'122'306	22'200'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.07.2024		3'667'810	43'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.07.2024		3'359'755	40'200'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.07.2024		3'158'475	129'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.07.2024		18'715'592	31'780'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		576'715'497	646'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.07.2024		4'700'000	4'166'461		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.07.2024		2'368'626	50'800'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.07.2024		1'161'347	9'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		4'677'829	4'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		4'622'478	5'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.07.2024		2'856'084	4'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		5'766'444	6'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.07.2024		2'536'560	20'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		10'769'832	12'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.07.2024		2'355'011	421'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		1'351'199	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		3'584'492	4'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.07.2024		1'392'422	1'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		2'827'451	2'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.07.2024		129'000'000	3'178'560		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.07.2024		52'400'000	33'953'628		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.07.2024		304'800'000	294'970'200		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.07.2024		45'400'000	52'296'260		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.07.2024		40'200'000	3'248'964		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.07.2024		22'621'000'000	129'407'955		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.07.2024		31'780'000	18'760'687		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.07.2024		185'550'000	9'148'580		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.07.2024		922'400'000	112'901'760		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.07.2024		43'200'000	3'578'256		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.07.2024		664'500'000	592'939'995		USD/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 25.07.2024		10'049'453	15'490'900'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 25.07.2024		5'065'428	93'198'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 25.07.2024		15'490'900'000	9'960'994		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 25.07.2024		93'198'300'000	5'113'874		IDR/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 12.09.2024		3'170'136	129'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.09.2024		52'011'284	45'400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.09.2024		33'799'624	52'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.09.2024		295'082'838	306'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 12.09.2024		3'233'768	40'200'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.09.2024		18'673'324	31'780'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.09.2024		127'763'390	22'300'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 12.09.2024		9'023'890	185'550'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.09.2024		113'479'530	930'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 12.09.2024		3'566'246	43'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.09.2024		594'362'360	670'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.09.2024		1'528'669	1'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.09.2024		1'800'000	2'039'177		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.09.2024		5'589'626	6'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.09.2024		1'328'422	1'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.09.2024		1'627'094	1'500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.09.2024		3'625'873	3'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.09.2024		9'227'831	10'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.09.2024		1'622'438	276'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.09.2024		300'000	328'879		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.09.2024		1'300'000	1'223'762		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.09.2024		2'262'129	18'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.09.2024		1'572'440	2'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.09.2024		2'239'172	2'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.09.2024		1'521'117	1'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.09.2024		1'337'276	1'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.09.2024		3'333'525	3'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.09.2024		1'904'736	16'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 12.09.2024		185'550'000	7'838'745		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 12.09.2024		22'576'800'000	134'112'965		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 12.09.2024		43'200'000	3'522'096		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 12.09.2024		31'780'000	17'912'161		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 12.09.2024		40'200'000	3'142'032		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.09.2024		313'200'000	292'528'800		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 12.09.2024		129'000'000	3'240'738		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.09.2024		964'800'000	114'627'888		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 12.09.2024		54'900'000	34'207'641		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 12.09.2024		46'000'000	50'910'040		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.09.2024		693'800'000	588'141'198		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KRW/CHF	Verfall 13.09.2024		9'927'061	15'490'900'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 13.09.2024		5'064'547	93'198'300'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 13.09.2024		93'198'300'000	5'116'625	IDR/CHF		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 13.09.2024		15'490'900'000	9'786'683	KRW/CHF		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 24.10.2024		7'748'568	185'550'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 24.10.2024		141'524'082	23'800'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 24.10.2024		3'512'333	43'200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 24.10.2024		3'128'726	40'200'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 24.10.2024		17'839'036	31'780'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 24.10.2024		299'832'876	322'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 24.10.2024		116'372'060	980'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 24.10.2024		34'077'528	54'900'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 24.10.2024		52'873'728	48'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.10.2024		609'002'668	722'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.10.2024		2'444'529	2'900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 24.10.2024		2'600'165	21'600'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 24.10.2024		2'012'667	16'700'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 24.10.2024		3'883'208	4'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		4'700'000	3'945'335	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		4'100'000	3'851'831	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.10.2024		400'000	450'352	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		1'600'000	1'505'379	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		1'600'000	1'347'288	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.10.2024		500'000	558'128	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		8'100'000	6'917'732	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		1'000'000	936'968	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		1'300'000	1'113'702	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.10.2024		100'000	111'806	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		1'300'000	1'220'756	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.10.2024		1'400'000	1'577'464	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		4'800'000	4'130'218	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 24.10.2024		18'000'000	2'175'462	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		3'000'000	2'586'180	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		1'600'000	1'502'886	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.10.2024		449'800'000	2'600'483	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 24.10.2024		43'200'000	3'546'288	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 24.10.2024		1'000'300'000	121'346'393	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.10.2024		701'400'000	606'984'546	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 24.10.2024		31'780'000	18'377'421	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.10.2024		45'600'000	51'208'800	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 24.10.2024		185'550'000	8'086'102	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.10.2024		23'350'200'000	133'829'336	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 24.10.2024		40'200'000	3'184'242	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 24.10.2024		54'900'000	34'377'282	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.10.2024		316'500'000	296'085'750	EUR/CHF		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 25.10.2024		3'232'972	129'000'000	CHF/THB		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 25.10.2024		129'000'000	3'331'941	THB/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 25.10.2024		9'757'574	15'490'900'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 25.10.2024		5'872'023	108'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 25.10.2024		108'000'000'000	6'005'705	IDR/CHF		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 25.10.2024		15'490'900'000	9'710'178	KRW/CHF		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.12.2024		120'225'489	993'000'000	CHF/CNY		-46'625.63	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 11.12.2024		3'536'136	43'200'000	CHF/SEK		53'004.68	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 11.12.2024		593'136'674	689'000'000	CHF/USD		-65'039.27	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 11.12.2024		18'291'297	31'780'000	CHF/AUD		362'683.15	0.02	b)
GBP/CHF	Verfall 11.12.2024		50'938'985	45'600'000	CHF/GBP		471'141.53	0.03	b)
MXN/CHF	Verfall 11.12.2024		7'975'700	185'550'000	CHF/MXN		52'722.41	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 11.12.2024		133'966'869	23'350'200'000	CHF/JPY		1'288'634.90	0.07	b)
NOK/CHF	Verfall 11.12.2024		3'168'644	40'200'000	CHF/NOK		30'235.86	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 11.12.2024		34'246'236	54'900'000	CHF/CAD		295'155.94	0.02	b)
EUR/CHF	Verfall 11.12.2024		291'498'875	312'600'000	CHF/EUR		-1'168'708.19	-0.07	b)
CHF/CNY	Verfall 11.12.2024		31'100'000	3'770'502	CNY/CHF		-3'666.73	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 11.12.2024		2'100'000	1'955'875	EUR/CHF		10'220.04	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 11.12.2024		2'621'614	21'600'000	CHF/CNY		5'416.94	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 11.12.2024		2'100'000	1'960'109	EUR/CHF		5'990.15	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 11.12.2024		9'900'000	8'540'621	USD/CHF		-17'097.36	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 11.12.2024		816'300'000	4'652'208	JPY/CHF		-13'934.86	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 11.12.2024		700'000	783'476	GBP/CHF		-8'748.70	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 12.12.2024		3'319'338	129'000'000	CHF/THB		25'152.25	0.00	b)
KRW/CHF	Verfall 12.12.2024		9'682'666	15'490'000'000	CHF/KRW		-1'822.52	0.00	b)
IDR/CHF	Verfall 12.12.2024		5'947'006	108'000'000'000	CHF/IDR		36'490.45	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							1'311'205.04	0.08	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Swaps							1'221'694.71	0.07	
02/53	IRS FIX LEG 2.95024% P.A USD	-14'000	0	0	-14'000 USD	85.30%	-10'325'937.38	-0.60	b)
02/53	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	14'000	0	0	14'000 USD	100.00	12'105'800.00	0.70	b)
03/54	IRS FIX LEG 2.3849% P.A. EUR	0	0	16'000	-16'000 EUR	104.75%	-15'733'594.16	-0.91	b)
03/54	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	0	16'000	0	16'000 EUR	100.00	15'020'138.72	0.87	b)
07/54	IRS FIX LEG 3.6265% P.A. USD	0	0	15'000	-15'000 USD	98.80%	-12'815'212.47	-0.74	b)
07/54	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	15'000	0	15'000 USD	100.00	12'970'500.00	0.75	b)

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		10'212'161.62	0.59
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		1'705'572'544.06	98.33
Derivative Finanzinstrumente		2'532'899.75	0.15
Sonstige Vermögenswerte		16'261'763.39	0.94
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'734'579'368.82	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten		-8'482.91	
Andere Verbindlichkeiten		-170'868.08	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'734'400'017.83	

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);	1'705'572'544.06	98.33
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	2'532'899.75	0.15
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56637850
CAD	1 = CHF	0.62032354
CNY	1 = CHF	0.12131288
COP	1'000 = CHF	0.19594000
CZK	100 = CHF	3.70883500
DKK	100 = CHF	12.58670000
EUR	1 = CHF	0.93875867
GBP	1 = CHF	1.11170156
IDR	10'000 = CHF	0.55090000
ILS	1 = CHF	0.23114758
JPY	100 = CHF	0.56766800
KRW	1 = CHF	0.00062659
MXN	1 = CHF	0.04315732
MYR	1 = CHF	0.19746517
NOK	100 = CHF	7.83924400
NZD	1 = CHF	0.51462621
PLN	1 = CHF	0.21573275
SEK	100 = CHF	8.08127100
SGD	1 = CHF	0.65363973
THB	100 = CHF	2.56245400
USD	1 = CHF	0.86470000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	52'053'433.31	3.001
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'356'463'543.65	78.209

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
ASTT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 01.11.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
ASTT CHF	0.450	0.700	0.350	0.100	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

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.

Benchmark

Bloomberg Global Aggregate ex CHF TR Index Value Unhedged CHF

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.

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
ASTT CHF 34)	Ja	CHF	1.996	-	1.996
NTH1 CHF	Ja	CHF	2.387	0.835	1.552

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

14 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Übersicht

	von	03.04.2023
	bis	31.10.2024
Konsolidiert	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		124'949'629.74
Klasse AT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'205.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		102.0588
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		102.0588
Thesaurierung je Anteil		0.78
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %
Klasse BT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'208.17
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		102.0817
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		102.0817
Thesaurierung je Anteil		0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.46 %
Klasse DT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		175'395.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'715.933
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		102.2160
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		102.2160
Thesaurierung je Anteil		0.93
Total Expense Ratio (TER)		0.27 %
Klasse NT CHF	CHF	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		124'753'819.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'168'649.621
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		106.7504
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		106.7504
Thesaurierung je Anteil		2.51
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %

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 AT CHF (Lancierung 29.02.2024)	2.06 %	-	-	-
Klasse BT CHF (Lancierung 29.02.2024)	2.08 %	-	-	-
Klasse DT CHF (Lancierung 29.02.2024)	2.43 %	-	-	-
Klasse NT CHF (Lancierung 03.04.2023)	4.39 %	3.93 %	-	-
Benchmark	3.99 %	3.24 %	-	-
Tracking Error ³³⁾	0.52 %	0.51 %	-	-

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse AT CHF (Lancierung 29.02.2024)	-1.93 %
Klasse BT CHF (Lancierung 29.02.2024)	-1.91 %
Klasse DT CHF (Lancierung 29.02.2024)	-1.56 %
Klasse NT CHF (Lancierung 03.04.2023)	0.40 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2024
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	128'421'220.50
Derivative Finanzinstrumente	281'713.28
Sonstige Vermögenswerte	1'409'302.31
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	130'112'236.09
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-5'162'186.71
Andere Verbindlichkeiten	-419.64
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	124'949'629.74

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AT CHF	von bis	Lancierung 29.02.2024 31.10.2024
Ausgegebene Anteile		257.096
Zurückgenommene Anteile		-157.096
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000

Klasse BT CHF	von bis	Lancierung 29.02.2024 31.10.2024
Ausgegebene Anteile		100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000

Klasse DT CHF	von bis	Lancierung 29.02.2024 31.10.2024
Ausgegebene Anteile		18'555.933
Zurückgenommene Anteile		-16'840.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'715.933

Klasse NT CHF	von bis	Lancierung 03.04.2023 31.10.2024
Ausgegebene Anteile		361'390.028
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		928'754.252
Zurückgenommene Anteile		-121'494.659
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'168'649.621

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	18.04.2023	87'217'525.07	874'159.593
Klasse NT CHF	20.03.2024	5'685'154.76	54'594.659

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	03.04.2023 31.10.2024
Saldo aus dem Anteilverkehr		116'689'134.91
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		8'260'494.83
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		124'949'629.74

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	03.04.2023 31.10.2024
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		22'214.65
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'919'761.22
Erträge aus Wertpapierleihe		29'560.20
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		300'333.33
Total Ertrag		3'271'869.40
Aufwand		
Reglementarische Vergütungen		-3'251.86
Ausrichtung laufende Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-322'013.80
Total Aufwand		-325'265.66
Nettoertrag / Verlust		2'946'603.74
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		909'605.85
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		99'030.08
Realisierter Erfolg		3'955'239.67
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		4'305'255.16
Gesamterfolg		8'260'494.83

Verwendung des Erfolges

Klasse AT CHF	31.10.2024
Nettoertrag	78.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	78.29
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	27.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	50.89
Total	78.29
Klasse BT CHF	31.10.2024
Nettoertrag	80.57
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	80.57
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	28.20
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	52.37
Total	80.57
Klasse DT CHF	31.10.2024
Nettoertrag	1'611.38
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'611.38
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	563.98
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'047.40
Total	1'611.38
Klasse NT CHF	31.10.2024
Nettoertrag	2'944'833.50
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'944'833.50
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'030'691.73
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'914'141.77
Total	2'944'833.50

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 03.04.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							128'421'220.50	98.70		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							128'421'220.50	98.70		
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	0	500	0	500 CHF	101.50%	507'500.00	0.39	a)	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	0	1'000	0	1'000 CHF	105.43%	1'054'300.00	0.81	a)	
CH0130501304	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 06/09/23	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	0	1'000	0	1'000 CHF	102.33%	1'023'300.00	0.79	a)	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0212184037	6.2541 % ALPHSW FLOAT PERP	0	1'000	0	1'000 CHF	99.52%	995'200.00	0.76	a)	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0228531437	2.3750 % KWLILJ 2 3/8 12/10/26	0	400	0	400 CHF	102.60%	410'400.00	0.32	a)	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0240109618	1.8750 % GZOWTZ 1 7/8 06/12/24 0001	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	0	3'000	0	3'000 CHF	100.00%	3'000'000.00	2.31	a)	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0244717978	1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.23%	1'002'300.00	0.77	a)	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	0	250	0	250 CHF	100.07%	250'175.00	0.19	a)	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	1'000	0	1'000 CHF	99.98%	999'800.00	0.77	a)	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	0	1'500	0	1'500 CHF	100.03%	1'500'450.00	1.15	a)	
CH0268988158	0.8750 % PARJNT 0 7/8 04/24/24	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	0	2'000	500	1'500 CHF	100.25%	1'503'750.00	1.16	a)	
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0293173453	1.2500 % LONNVX 1 1/4 09/22/23	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	1'975	1'975	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0316994661	1.0000 % IMPNSW 1 03/20/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	0	1'000	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.76	a)	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0357483160	2.0000 % KWLILJ 2 12/11/23	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	0	2'000	0	2'000 CHF	99.60%	1'992'000.00	1.53	a)	
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0379610964	0.6250 % ORONSW 0 5/8 09/26/23	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0398633450	0.8750 % MOBNSW 0 7/8 10/02/23	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	0	1'800	1'600	200 CHF	99.61%	199'220.00	0.15	a)	
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0404311729	2.0000 % SLHNVX 2 PERP	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	0	500	0	500 CHF	99.88%	499'400.00	0.38	a)	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.09%	500'450.00	0.38	a)	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	0	425	425	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 03.04.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0418609621	0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041246	0.1250 % PBBGR 0 1/8 06/05/23 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	0	600	0	600 CHF	97.60%	585'600.00	0.45	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0422393121	0.8750 % EFIAGC 0 7/8 10/18/23	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	0	1'000	0	1'000 CHF	98.95%	989'500.00	0.76	a)
CH0426621683	1.1250 % BACR 1 1/8 07/12/23 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	99.94%	1'299'220.00	1.00	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595628	1.8750 % TEMNSW 1 7/8 11/30/23	0	120	120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	600	0	600 CHF	98.25%	589'500.00	0.45	a)
CH0472691408	0.8000 % AMPAU 0.8 07/18/23 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180995	1.7500 % CFTSW 1 3/4 07/30/25	0	525	150	375 CHF	99.72%	373'950.00	0.29	a)
CH0494734343	0.4500 % BANORT 0.45 12/18/23	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393371	0.3800 % COMQAT 0.38 10/19/23 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071304	1.5500 % RIENSW 1.55 09/17/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071379	0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23	0	950	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	0	600	0	600 CHF	97.60%	585'600.00	0.45	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.73	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893172	1.5000 % BCHNSW 1 1/2 09/30/24	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0551990713	0.7525 % HYUCAP 0.7525 07/06/23 GMTN	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	0	1'000	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.77	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	0	1'250	50	1'200 CHF	99.95%	1'199'400.00	0.92	a)
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	0	900	675	225 CHF	99.74%	224'415.00	0.17	a)
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	0	500	0	500 CHF	99.69%	498'450.00	0.38	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	0	300	0	300 CHF	98.45%	295'350.00	0.23	a)
CH0598928759	1.7500 % SLHNVX 1 3/4 PERP	0	1'105	0	1'105 CHF	100.70%	1'112'735.00	0.86	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	97.55%	1'463'250.00	1.12	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	0	3'000	0	3'000 CHF	99.80%	2'994'000.00	2.30	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	0	250	0	250 CHF	98.55%	246'375.00	0.19	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995778	0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	0	2'250	750	1'500 CHF	97.95%	1'469'250.00	1.13	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	950	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.65%	976'500.00	0.75	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	0	630	630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 03.04.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1145096173	2.0000 % IMPNSW 2 11/26/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266211	1.8750 % CFTSW 1 7/8 12/20/27	0	750	220	530 CHF	100.00%	530'000.00	0.41 a)	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	0	600	0	600 CHF	98.93%	593'580.00	0.46 a)	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	98.50%	1'477'500.00	1.14 a)	
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	0	250	0	250 CHF	98.95%	247'375.00	0.19 a)	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	0	850	500	350 CHF	99.90%	349'650.00	0.27 a)	
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	0	600	0	600 CHF	98.73%	592'380.00	0.46 a)	
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	0	600	0	600 CHF	98.80%	592'800.00	0.46 a)	
CH1167887285	0.0000 % ABBNVX 0 09/25/23	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	2'500	500	2'000 CHF	101.20%	2'024'000.00	1.56 a)	
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	0	1'250	0	1'250 CHF	100.60%	1'257'500.00	0.97 a)	
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	2'500	1'500	1'000 CHF	100.90%	1'009'000.00	0.78 a)	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	600	0	600 CHF	100.30%	601'800.00	0.46 a)	
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	101.30%	810'400.00	0.62 a)	
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.65%	1'524'750.00	1.17 a)	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	0	350	0	350 CHF	102.35%	358'225.00	0.28 a)	
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	0	1'000	0	1'000 CHF	101.24%	1'012'400.00	0.78 a)	
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	0	1'500	0	1'500 CHF	102.05%	1'530'750.00	1.18 a)	
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	0	700	0	700 CHF	104.55%	731'850.00	0.56 a)	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	350	0	350 CHF	105.55%	369'425.00	0.28 a)	
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	0	750	0	750 CHF	101.53%	761'475.00	0.59 a)	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	0	250	0	250 CHF	101.21%	253'025.00	0.19 a)	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.50%	1'552'500.00	1.19 a)	
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	0	250	0	250 CHF	100.70%	251'750.00	0.19 a)	
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	300	0	300 CHF	101.55%	304'650.00	0.23 a)	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	0	300	0	300 CHF	100.11%	300'330.00	0.23 a)	
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	500	0	500 CHF	101.00%	505'000.00	0.39 a)	
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	0	950	0	950 CHF	103.00%	978'500.00	0.75 a)	
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.03%	1'515'450.00	1.16 a)	
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	1'700	0	1'700 CHF	104.10%	1'769'700.00	1.36 a)	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	1'500	0	1'500 CHF	103.05%	1'545'750.00	1.19 a)	
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	950	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651937	2.3500 % KWLILU 2.35 03/01/27	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	0	1'300	0	1'300 CHF	101.17%	1'315'210.00	1.01 a)	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	250	0	250 CHF	105.29%	263'225.00	0.20 a)	
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	500	0	500 CHF	101.83%	509'150.00	0.39 a)	
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.07%	500'350.00	0.38 a)	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	104.05%	1'248'600.00	0.96 a)	
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	750	0	750 CHF	104.25%	781'875.00	0.60 a)	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	104.50%	1'567'500.00	1.20 a)	
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	105.45%	2'109'000.00	1.62 a)	
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	1'000	0	1'000 CHF	102.23%	1'022'300.00	0.79 a)	
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	104.05%	624'300.00	0.48 a)	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	1'500	0	1'500 CHF	104.45%	1'566'750.00	1.20 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 03.04.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.80%	1'527'000.00	1.17	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.68%	1'006'800.00	0.77	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	105.10%	1'051'000.00	0.81	a)
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.75%	2'075'000.00	1.59	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	1'000	50	950 CHF	103.30%	981'350.00	0.75	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	106.10%	1'061'000.00	0.82	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	1'400	0	1'400 CHF	103.55%	1'449'700.00	1.11	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	106.05%	1'590'750.00	1.22	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	1'000	0	1'000 CHF	101.19%	1'011'900.00	0.78	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'000	800	200 CHF	103.75%	207'500.00	0.16	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.30%	1'043'000.00	0.80	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	1'000	0	1'000 CHF	104.05%	1'040'500.00	0.80	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.05%	1'545'750.00	1.19	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	1'000	0	1'000 CHF	104.65%	1'046'500.00	0.80	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	1'000	0	1'000 CHF	103.30%	1'033'000.00	0.79	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	900	0	900 CHF	104.60%	941'400.00	0.72	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.10%	1'021'000.00	0.78	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	1'275	1'275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.40%	1'044'000.00	0.80	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.25%	1'042'500.00	0.80	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.85%	1'527'750.00	1.17	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	930	0	930 CHF	106.20%	987'660.00	0.76	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	106.45%	1'064'500.00	0.82	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	2'000	0	2'000 CHF	101.75%	2'035'000.00	1.56	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	1'500	0	1'500 CHF	104.10%	1'561'500.00	1.20	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	500	0	500 CHF	102.00%	510'000.00	0.39	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.40%	1'024'000.00	0.79	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	1'580	1'330	250 CHF	101.80%	254'500.00	0.20	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	1'000	0	1'000 CHF	103.85%	1'038'500.00	0.80	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.95%	1'029'500.00	0.79	a)
CH1321508348	2.2800 % BACRED 2.28 06/19/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.05%	1'040'500.00	0.80	a)
CH1321508355	1.8300 % TOYOTA 1.83 09/18/28 EMTN	0	980	0	980 CHF	102.75%	1'006'950.00	0.77	a)
CH1321508363	1.5650 % EDF 1.565 09/06/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.50%	1'015'000.00	0.78	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	870	870	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.80%	1'028'000.00	0.79	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.78	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.70%	1'037'000.00	0.80	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.20%	1'012'000.00	0.78	a)
CH1335850306	2.8000 % UINT 2.8 07/23/27	0	1'000	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.78	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.75%	1'027'500.00	0.79	a)
CH1341034952	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 APR	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316687	3.0000 % IMPNSW 3 05/17/28	0	1'000	0	1'000 CHF	103.10%	1'031'000.00	0.79	a)
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28 4Y	0	1'000	0	1'000 CHF	101.95%	1'019'500.00	0.78	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	1'000	0	1'000 CHF	102.35%	1'023'500.00	0.79	a)
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	0	1'000	0	1'000 CHF	102.70%	1'027'000.00	0.79	a)
CH1349302930	0.9750 % ACANXB 0.975 04/23/29	0	950	0	950 CHF	100.15%	951'425.00	0.73	a)
CH1350727785	1.6500 % SCMNWX 1.65 08/23/30	0	1'000	0	1'000 CHF	103.75%	1'037'500.00	0.80	a)
CH1353257806	1.6000 % NOVNVX 1.6 06/18/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	0	865	0	865 CHF	104.05%	900'032.50	0.69	a)
CH1356570353	2.0150 % RENAUL 2.015 10/29/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.40%	1'014'000.00	0.78	a)
CH1357852784	1.4500 % IRENSW 1.45 10/16/26	0	500	0	500 CHF	100.80%	504'000.00	0.39	a)
CH1373904403	1.6000 % GALDSW 1.6 09/27/28	0	1'000	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.78	a)
CH1376931536	1.2000 % BMW 1.2 10/09/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.45%	1'004'500.00	0.77	a)
CH1377443853	1.6700 % ACAFP 1.67 09/26/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.50%	1'015'000.00	0.78	a)
CH1380011291	1.3500 % EMMI 1.35 10/30/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.78	a)
CH1380011374	1.7750 % PLANSW 1.775 11/27/29	0	1'000	0	1'000 CHF	100.50%	1'005'030.00	0.77	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 03.04.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1380508411	2.0725 % DB 2.0725 09/18/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.78	a)
CH1380910328	1.3750 % ACLNSW 1 3/8 11/14/30	0	950	0	950 CHF	100.38%	953'572.00	0.73	a)
CH1380910377	1.5000 % ISHZ 1 1/2 11/08/29	0	800	0	800 CHF	100.19%	801'536.00	0.62	a)
CHF							128'421'220.50	98.70	

Derivative Finanzinstrumente

281'713.28 0.22

Swaps

281'713.28 0.22

04/28	IRS FIX LEG 1.9% P.A. CHF	0	10'000	5'000	5'000 CHF	105.63%	5'281'713.28	4.06	b)
04/28	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	5'000	10'000	-5'000 CHF	100.00	-5'000'000.00	-3.84	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	128'421'220.50	98.70
Derivative Finanzinstrumente	281'713.28	0.22
Sonstige Vermögenswerte	1'409'302.31	1.08
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	130'112'236.09	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-5'162'186.71	
Andere Verbindlichkeiten	-419.64	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	124'949'629.74	

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);	128'421'220.50	98.70
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	281'713.28	0.22
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

15'955'675.00 12.26

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte						Kurswert CHF	in % 7)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	600	CHF	98.25%	589'500.00	0.45	
CH0598928759	1.7500 % SLHNVX 1 3/4 PERP	105	CHF	100.70%	105'735.00	0.08	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	1'500	CHF	97.95%	1'469'250.00	1.13	
CH1148266211	1.8750 % CFTSW 1 7/8 12/20/27	500	CHF	100.00%	500'000.00	0.38	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	600	CHF	98.93%	593'580.00	0.46	
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'250	CHF	100.60%	1'257'500.00	0.97	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	600	CHF	100.30%	601'800.00	0.46	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	350	CHF	102.35%	358'225.00	0.28	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	350	CHF	105.55%	369'425.00	0.28	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	1'500	CHF	103.50%	1'552'500.00	1.19	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'500	CHF	103.05%	1'545'750.00	1.19	
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	200	CHF	101.83%	203'660.00	0.16	
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	500	CHF	100.07%	500'350.00	0.38	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	1'200	CHF	104.05%	1'248'600.00	0.96	
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	600	CHF	104.05%	624'300.00	0.48	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	1'500	CHF	104.45%	1'566'750.00	1.20	
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	1'500	CHF	106.05%	1'590'750.00	1.22	
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	250	CHF	101.80%	254'500.00	0.20	
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	1'000	CHF	102.35%	1'023'500.00	0.79	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	4'165'110.60	23.428
Bond	CHF	13'072'450.99	73.529
Equity	CHF	541'144.19	3.044
Total	CHF	17'778'705.78	100.000

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	5'281'713.28	4.227
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	-	-
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 03.04.2023 - 31.10.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AT CHF	CHF	-	-	-	-
BT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	15'955'675.00
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

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: 03.04.2023 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
NT CHF	-	-	-	-	2.000

Periode: 29.02.2024 - 31.10.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AT CHF	0.500	1.200	0.400	0.010	2.000
BT CHF	0.460	0.900	0.360	0.100	2.000
DT CHF	0.270	0.700	0.220	0.050	2.000

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.

Benchmark

SBI@ AAA-BBB 1-5 TR

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.

Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 19.02.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 24.02.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AT CHF	Nein	CHF	0.78290	0.27401	0.50889
BT CHF	Nein	CHF	0.80570	0.28199	0.52371
DT CHF	Nein	CHF	0.93906	0.32867	0.61039
NT CHF	Nein	CHF	2.519	0.881	1.638

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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

15 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert 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 in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder 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, 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 im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben 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 sich 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, marktconforme 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 Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken.

Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

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 § 19 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 Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe 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 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 des Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Investment Fund I**

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung in den Bestimmungen betreffend die währungsabgesicherten Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfährt die Nachhaltigkeitspolitik in der Anlagepolitik des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates eine Anpassung (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

In der teilfondsspezifischen Anlagepolitik sämtlicher Teilvermögen des Umbrella-Fonds ist eine Ergänzung in den Bestimmungen zu den zulässigen Anlagen vorgesehen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Zudem werden die Bestimmungen in der Risikoverteilung ergänzt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

1 Änderungen bei den währungsabgesicherten Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Die Eigenschaften der währungsabgesicherten Anteilsklassen werden beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced, bei welchen "H1" an dritter Stelle der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse steht, gegenüber den bisherigen Bestimmungen angepasst.

Dabei handelt es sich um Anteilsklassen mit folgenden Bezeichnungen:

- ATH1 CHF, ATH1 EUR, ATH1 GBP, ATH1 USD, AAH1 CHF, AAH1 EUR, AAH1 GBP, AAH1 USD,
- BTH1 CHF, BTH1 EUR, BTH1 GBP, BTH1 USD, BAH1 CHF, BAH1 EUR, BAH1 GBP, BAH1 USD,
- FTH1 CHF, FTH1 EUR, FTH1 GBP, FTH1 USD, FAH1 CHF, FAH1 EUR, FAH1 GBP, FAH1 USD,
- CTH1 CHF, CTH1 EUR, CTH1 GBP, CTH1 USD, CAH1 CHF, CAH1 EUR, CAH1 GBP, CAH1 USD,
- DTH1 CHF, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD, DAH1 CHF, DAH1 EUR, DAH1 GBP, DAH1 USD,
- GTH1 CHF, GTH1 EUR, GTH1 GBP, GTH1 USD, GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD,
- MTH1 CHF, MTH1 EUR, MTH1 GBP, MTH1 USD, MAH1 CHF, MAH1 EUR, MAH1 GBP, MAH1 USD,
- NTH1 CHF, NTH1 EUR, NTH1 GBP, NTH1 USD, NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP, NAH1 USD,
- STH1 CHF, STH1 EUR, STH1 GBP, STH1 USD, SAH1 CHF, SAH1 EUR, SAH1 GBP, SAH1 USD.

Bei diesen Anteilsklassen wird für das oben genannte Teilvermögen neu festgehalten, dass die Risikoaussetzung bezüglich Anlagewährungen bestmöglich gemäss den Regeln des Referenzindex gegen die jeweilige Referenzwährung abgesichert wird. Das kann dazu führen, dass es zwischen den gemäss den Regeln des Referenzindex angesetzten Terminen (normalerweise monatlich) der Währungsabsicherungsanpassungen zu einer Über- oder Unterdeckung kommen kann. Bei Zeichnungen und Rücknahmen erfolgt der Aufbau der Währungsabsicherung, respektive der Abbau der Währungsabsicherung gemäss dem aktuellen Währungsabsicherungsgrad der Anteilsklasse, so dass die Über- oder Unterdeckung der Währungsabsicherung der gesamten Anteilsklasse bestehen bleibt (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages).

2 Änderung der Nachhaltigkeitspolitik in der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Bezüglich CO₂e-Ziel wird in § 8 Ziff. 3 des Fondsvertrages neu bestimmt, dass der Vermögensverwalter die Anlagetätigkeit auf eine Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen im Vergleich zur CO₂e-Intensität der Anlagen im Referenzindex (Bloomberg Global Treasury TR Index Unhedged CHF) ausrichtet und dass sich weitere Informationen zur Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen im Vergleich zum Referenzindex im Prospekt finden.

3 Ergänzung in der teilfondsspezifischen Anlagepolitik

Die Anlagepolitik soll im Fondsvertrag der nachstehend aufgeführten Teilvermögen in § 8 Ziff. 5 A Bst. I, § 8 Ziff. 5 B Bst. k, § 8 Ziff. 5 C Bst. k, § 8 Ziff. 5 D Bst. m, § 8 Ziff. 5 E Bst. I, § 8 Ziff. 5 F Bst. k, § 8 Ziff. 5 G Bst. m, § 8 Ziff. 5 H Bst. k, § 8 Ziff. 5 I Bst. I, § 8 Ziff. 5 J Bst. I und § 8 Ziff. 5 K Bst. k des Fondsvertrages jeweils ergänzt werden.

In den erwähnten für alle Anlagen relevanten neuen Bestimmungen finden sich Ausführungen zu Contingent Convertible Bonds (CoCos).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 A Bst. I des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. k des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 C Bst. k des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 D Bst. m des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 E Bst. l des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. k des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. m des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind. Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. k des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind.

Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 I Bst. I des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind.

Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 J Bst. I des Fondsvertrages).

In den neuen Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) ist neu festgehalten, dass Contingent Convertible Bonds (CoCos) zulässig sind, sofern sie im Referenzindex enthalten sind oder eine Aufnahme in den Referenzindex nach ihrer Liberierung (aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien) mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist oder sie aufgrund ihrer Fälligkeit aus dem Referenzindex gefallen sind.

Die Überschreitung der im Referenzindex enthaltenen Quote der CoCos darf maximal 5 Prozentpunkte betragen (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. k des Fondsvertrages).

4 Ergänzungen in der Risikoverteilung

4.1 Ergänzung für sämtlichen Teilvermögen

Die bestehende Bestimmung in § 16 Ziff. 4 des Fondsvertrages hat zum Inhalt, dass wenn sich ein Teilvermögen an einem Referenzindex orientiert, so darf der Anteil an Effekten oder Geldmarktinstrumenten desselben Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens die Limiten von Ziff. 3 von § 16 des Fondsvertrages übersteigen, falls dies zur Orientierung am Referenzindex erforderlich ist. Die effektive Gewichtung im Referenzindex darf dabei jedoch höchstens um 5 Prozentpunkte überschritten werden. Die Anlagen sind diesfalls auf mindestens 12 Emittenten aufzuteilen, wobei das Gesamtvolumen der 10% des Vermögens eines Teilvermögens überschreitenden Titel 75% des Vermögens eines Teilvermögens nicht überschreiten darf.

Neu soll diese Bestimmung mit einem Vorbehalt von Ziff. 13 und Ziff. 14 von § 16 des Fondsvertrages ergänzt werden.

Die Bestimmungen in § 16 Ziff. 13 und Ziff. 14 sind unverändert und lauten weiterhin wie folgt:

- " 13. Die in Ziff. 3 erwähnte Grenze von 10% ist auf 35% angehoben, wenn die Effekten oder Geldmarktinstrumente von einem OECD-Staat oder einer öffentlich-rechtlichen Körperschaft aus der OECD oder von internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen die Schweiz oder ein Mitgliedstaat der Europäischen Union angehören, begeben oder garantiert werden. Die Einzellimiten von Ziff. 3 und 6 jedoch dürfen mit der vorliegenden Limite von 35% nicht kumuliert werden.
14. Die in Ziff. 3 erwähnte Grenze von 10% ist auf 100% angehoben, wenn die Effekten oder Geldmarktinstrumente von einem OECD-Staat, einer öffentlich-rechtlichen Körperschaft aus der OECD oder von internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen die Schweiz oder ein Mitgliedstaat der Europäischen Union angehören, begeben oder garantiert werden. In diesem Fall muss das entsprechende Teilvermögen Effekten oder Geldmarktinstrumente aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen halten; höchstens

30% des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens dürfen in Effekten oder Geldmarktinstrumente derselben Emission angelegt werden.

Als Emittenten bzw. Garanten im Sinne von Ziff. 13 und 14 sind neben den OECD-Staaten zugelassen: Europäische Union (EU), Europarat, Eurofinanz, Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung (Weltbank), Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, Europäische Investitionsbank, Interamerikanische Entwicklungsbank, Nordic Entwicklungsbank, Asiatische Entwicklungsbank, Afrikanische Entwicklungsbank, European Company for the Financing of Railroad Rolling Stock (Eurofima), Kreditanstalt für Wiederaufbau (KfW), International Finance Corporation (IFC), European Stability Mechanism (ESM) und European Financial Stability Facility (EFSF) sowie der Kanton Zürich. "

4.2 Ergänzung für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International, Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) und Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

In der bestehenden Bestimmung in Ziff. 5 von § 16 des Fondsvertrages ist aufgeführt, dass die Fondsleitung höchstens 20% des Vermögens eines Teilvermögens in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank anlegen darf. In diese Limite sind sowohl Bankguthaben im Sinne von § 8 des Fondsvertrages wie flüssige Mittel gemäss § 9 des Fondsvertrages einzubeziehen.

Neu soll diese Bestimmung ergänzt und neu normiert werden, dass die Quote bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International, Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) und Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced höchstens 30% beträgt, sofern das Rating A-1 oder gleichwertig erreicht.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. Februar 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Investment Fund I**
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International
Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)
Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

In der Mitteilung vom 27. Februar 2024 wurde unter Ziff. 4.2 beantragt, dass für die oben erwähnten Teilvermögen neu höchstens 30% des jeweiligen Teilvermögens in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank angelegt werden können, sofern das Rating A-1 oder gleichwertig erreicht.

Die beantragten Anpassungen des Fondsvertrages in Ziff. 5 von § 16 werden zurückgezogen.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 17. April 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund I

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachstehend der "Umbrella-Fonds")

Betrifft die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF
Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF
Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate
Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality
Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)
Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International
Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland
Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced
(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Anpassungen in der Nachhaltigkeitspolitik

Nebst formellen Änderungen werden im Fondsvertrag Hinweise auf das auf Institutsebene nach Massgabe interner Konzepte zur Anwendung gelangende Stewardship (Voting & Engagement) aufgenommen, vgl. § 8 Ziff. 3.1, Ziff. 3.2 und Ziff. 4 des Fondsvertrages.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. September 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich