

SWISSCANTO (CH) EQUITY FUND SUSTAINABLE INTERNATIONAL

Jahresbericht per 31.10.2023

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

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

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 23. Februar 2024

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 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 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)

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2023, 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), 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.

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 Unvollständigkeits, 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

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2023, 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	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	17
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
7	Pauschale Verwaltungskommission	18
8	Benchmark	18
9	TER	18
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	18
11	Sonderausschüttung 2022 / 2023	19
12	Fussnoten	19
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20
14	Pflichtpublikationen	22

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 (ab 03.01.2023)
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		764'299'472.40	666'192'824.68	605'392'792.30	449'856'046.30
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'351'333.47	3'897'542.49	5'012'246.18	53'148'294.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		44'419.380	27'339.148	28'857.322	445'282.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		142.9856	142.5627	173.6906	119.3587
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		142.8856	142.6625	173.8122	119.4542
Thesaurierung je Anteil		0.84	0.63	0.19	0.13
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'479'563.07	9'165'223.02		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		115'630.275	112'217.275		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.9817	81.6739		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.9243	81.7311		
Thesaurierung je Anteil		0.61	0.53		
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %		
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'129'264.98	8'062'150.91	9'766'065.07	758'740.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		64'118.076	64'118.076	64'118.076	7'297.484
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		126.7859	125.7391	152.3138	103.9729
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		126.6971	125.8271	152.4204	104.0561
Thesaurierung je Anteil		1.84	1.72	1.29	0.77
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		599'194'540.46	535'563'370.74	532'118'504.00	395'949'011.42
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		278'824.325	251'251.642	206'057.145	224'480.468
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		2'149.0038	2'131.5816	2'582.3832	1'763.8462
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		2'147.4995	2'133.0737	2'584.1908	1'765.2572
Thesaurierung je Anteil		30.86	28.89	21.47	15.81
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		141'144'770.42	109'504'537.52	58'495'977.05	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'510'299.618	1'239'266.127	513'898.892	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.4548	88.3624	113.8278	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		93.3894	88.4243	113.9075	
Thesaurierung je Anteil		1.37	1.26	0.86	
Total Expense Ratio (TER)		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

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF	0.45 %	-21.67 %	30.61 %	17.99 %
Klasse GT CHF (Lancierung 10.12.2021)	0.60 %	-21.55 %	0.11 %	-
Klasse MT CHF (Lancierung 29.01.2020)	1.17 %	-20.95 %	31.72 %	16.87 %
Klasse NT CHF	1.29 %	-21.02 %	31.70 %	19.00 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2021)	6.26 %	-22.64 %	15.36 %	-
Benchmark Hedge	5.52 %	-18.11 %	-	-
Benchmark	0.55 %	-16.87 %	25.65 %	5.92 %
Tracking Error 33)	3.27 %	5.59 %	3.53 %	6.00 %

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	-0.10 %
Klasse GT CHF (Lancierung 10.12.2021)	0.05 %
Klasse MT CHF (Lancierung 29.01.2020)	0.62 %
Klasse NT CHF	0.74 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 30.04.2021)	0.74 %

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)	31.10.2023	31.10.2022
Bankguthaben auf Sicht	42'701'360.57	3'136'544.36
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	721'058'396.34	662'469'274.03
Derivative Finanzinstrumente	0.00	-14'038.64
Sonstige Vermögenswerte	754'567.10	826'438.61
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	764'514'324.01	666'418'218.36
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-46'960.01
Andere Verbindlichkeiten	-214'851.61	-178'433.67
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	764'299'472.40	666'192'824.68

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		27'339.148	28'857.322
Ausgegebene Anteile		42'989.728	11'752.258
Zurückgenommene Anteile		-25'909.496	-13'270.432
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		44'419.380	27'339.148

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 10.12.2021 31.10.2022
Klasse GT CHF			<i>Lancierung</i>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		112'217.275	-
Ausgegebene Anteile		3'413.000	112'217.275
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		115'630.275	112'217.275

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		64'118.076	64'118.076
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		64'118.076	64'118.076

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		251'251.642	206'057.145
Ausgegebene Anteile		108'000.983	123'138.376
Zurückgenommene Anteile		-80'428.300	-77'943.879
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		278'824.325	251'251.642

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'239'266.127	513'898.892
Ausgegebene Anteile		646'820.593	819'492.234
Zurückgenommene Anteile		-375'787.102	-94'124.999
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'510'299.618	1'239'266.127

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		666'192'824.68	605'392'792.30
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'337'430.73	-1'853'941.92
Saldo aus dem Anteilverkehr		86'716'186.00	177'850'043.51
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		14'727'892.45	-115'196'069.21
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		764'299'472.40	666'192'824.68

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		64'399.84	1.15
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-570.40	-18'019.23
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		9'870'256.94	7'534'872.76
Erträge der Gratisaktien		247'200.74	333'201.84
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		0.00	512.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'661'263.99	2'265'596.12
Total Ertrag		11'842'551.11	10'116'165.39
Aufwand			
Passivzinsen		-12.36	130.58
Reglementarische Vergütungen		-115'037.20	-78'977.34
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-3'804.94
Ausrichtung laufende Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-823'601.60	-1'020'850.84
Total Aufwand		-938'735.16	-1'103'502.54
Nettoertrag / Verlust		10'903'815.95	9'012'662.85
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'960'093.02	17'945'339.55
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		38'632.36	0.00
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		320'423.78	324'437.60
Realisierter Erfolg		7'302'779.07	27'282'440.00
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		7'425'113.38	-142'478'509.21
Gesamterfolg		14'727'892.45	-115'196'069.21

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	37'722.28	17'428.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	37'722.28	17'428.10
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	13'202.80	6'099.83
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	24'519.48	11'328.27
Total	37'722.28	17'428.10
<hr/>		
Klasse GT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	70'792.50	59'723.65
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	70'792.50	59'723.65
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	24'777.38	20'903.28
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	46'015.12	38'820.37
Total	70'792.50	59'723.65
<hr/>		
Klasse MT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	118'501.52	110'709.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	118'501.52	110'709.39
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	41'475.53	38'748.29
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	77'025.99	71'961.10
Total	118'501.52	110'709.39
<hr/>		
Klasse NT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	8'605'346.17	7'259'571.38
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'605'346.17	7'259'571.38
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'011'871.16	2'540'849.98
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	5'593'475.01	4'718'721.40
Total	8'605'346.17	7'259'571.38
<hr/>		
Klasse NTH1 CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	2'071'453.48	1'565'230.33
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'071'453.48	1'565'230.33
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	725'008.72	547'830.62
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'346'444.76	1'017'399.71
Total	2'071'453.48	1'565'230.33

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							721'058'396.34	94.32	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							721'058'396.34	94.32	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	0	1'744'657	118'686	1'625'971 AUD	13.38	12'535'474.45	1.64	a)
AU							12'535'474.45	1.64	
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	75'807	1'773	77'580	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	150'503	80'894	85'983	145'414 CAD	86.22	8'218'864.36	1.08	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	144'242	92'921	55'871	181'292 CAD	51.38	6'106'190.00	0.80	a)
CA							14'325'054.36	1.87	
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	34'073	34'073	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH							0.00	0.00	
DE0005664809	EVOTEC SE	99'498	46'245	13'069	132'674 EUR	16.27	2'076'420.75	0.27	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	249'442	96'711	127'057	219'096 EUR	27.48	5'790'474.24	0.76	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	79'796	63'149	37'865	105'080 EUR	124.96	12'630'864.17	1.65	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	77'101	16'561	60'540 EUR	220.90	12'864'121.00	1.68	a)
DE000ENAG999	E.ON SE	0	359'682	20'548	339'134 EUR	11.22	3'660'211.43	0.48	a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	163'242	444'171	607'413	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
US30050E1055	EVOTEC SE - SPON ADR	40'273	0	7'103	33'170 USD	8.61	259'904.55	0.03	a)
DE							37'281'996.14	4.88	
DK0060094928	ORSTED A/S	67'591	24'144	91'735	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	50'015	68'951	118'966	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	219'221	327'246	262'397	284'070 DKK	152.26	5'574'279.03	0.73	a)
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	195'216	24'883	170'333 DKK	677.00	14'861'579.59	1.94	a)
DK							20'435'858.62	2.67	
FR0000120628	AXA SA	301'978	0	301'978	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120644	DANONE	32'759	182'754	45'889	169'624 EUR	56.15	9'161'762.83	1.20	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	27'476	54'258	16'748	64'986 EUR	144.98	9'062'956.30	1.19	a)
FR							18'224'719.13	2.38	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	98'398	46'675	116'947	28'126 GBP	10'250.00	3'183'603.52	0.42	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	309'584	161'502	125'199	345'887 EUR	4'464.61	14'854'543.98	1.94	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	1'076'081	1'794'041	1'143'825	1'726'297 GBP	178.20	3'397'115.82	0.44	a)
IE00BZ12WP82	LINDE PLC	36'314	6'824	43'138	0 USD	0.00	0.00	0.00	
LIN GRXXX	LINDE PLC	0	47'093	47'093	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB							21'435'263.32	2.80	
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	27'491	2'053	29'544	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	56'755	20'143	38'688	38'210 USD	297.09	10'330'713.69	1.35	a)
IE							10'330'713.69	1.35	
US83417M1045	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	45'821	23'539	56'335	13'025 USD	75.95	900'265.82	0.12	a)
IL							900'265.82	0.12	
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	0	210'418	13'048	197'370 EUR	35.29	6'699'999.70	0.88	a)
IT							6'699'999.70	0.88	
JP3358000002	SHIMANO INC	33'293	8'000	11'000	30'293 JPY	21'555.00	3'923'742.21	0.51	a)
JP3435000009	SONY GROUP CORP	151'069	82'500	64'900	168'669 JPY	12'425.00	12'593'365.89	1.65	a)
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	30'500	86'400	50'600	66'300 JPY	19'755.00	7'870'470.88	1.03	a)
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	0	262'400	50'500	211'900 JPY	7'220.00	9'193'445.55	1.20	a)
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	184'320	168'200	45'700	306'820 JPY	3'343.00	6'163'539.68	0.81	a)
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	532'929	339'500	172'200	700'229 JPY	1'900.00	7'994'730.86	1.05	a)
JP							47'739'295.07	6.24	
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	52'734	12'990	30'953	34'771 EUR	47.83	1'599'777.36	0.21	a)
LU							1'599'777.36	0.21	
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	17'033	5'204	22'237	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010273215	ASML HOLDING NV	19'352	6'874	8'394	17'832 EUR	565.30	9'696'634.48	1.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	311'141	130'984	188'394	253'731	EUR	28.00	6'833'977.53	0.89 a)
NL0011821202	ING GROEP NV	274'029	16'379	290'408	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL							16'530'612.01	2.16	
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	77'689	2'540	80'229	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	582'513	423'883	227'013	779'383	SEK	64.18	4'074'362.81	0.53 a)
SE0017768716	BOLIDEN AB	319'795	76'583	396'378	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0020050417	BOLIDEN AB	0	298'888	36'697	262'191	SEK	285.75	6'102'574.31	0.80 a)
SE0020050425	BOLIDEN AB RED SHS	0	245'744	245'744	0	SEK	0.00	0.00	0.00
US0528001094	AUTOLIV INC	68'428	33'428	28'116	73'740	USD	91.65	6'150'364.52	0.80 a)
SE							16'327'301.64	2.14	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1'137'996	623'100	358'400	1'402'696	SGD	12.68	11'814'399.40	1.55 a)
SG							11'814'399.40	1.55	
IE00059Y5762	LINDE PLC	0	51'813	7'923	43'890	USD	382.16	15'264'270.83	2.00 a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	0	73'617	8'003	65'614	USD	207.91	12'414'726.22	1.62 a)
US0010551028	AFLAC INC	211'645	89'354	94'245	206'754	USD	78.11	14'696'902.47	1.92 a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	100'253	26'260	126'513	0	USD	0.00	0.00	0.00
US00724F1012	ADOBE INC	0	28'448	4'188	24'260	USD	532.06	11'746'721.18	1.54 a)
US0126531013	ALBEMARLE CORP	39'360	31'965	41'359	29'966	USD	126.78	3'457'361.38	0.45 a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	296'924	137'191	164'091	270'024	USD	124.08	30'490'841.14	3.99 a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	0	89'900	0	89'900	USD	133.09	10'888'558.05	1.42 a)
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	52'189	50'734	50'300	52'623	USD	117.65	5'634'206.87	0.74 a)
US0367521038	ANTHEM INC	0	12'962	607	12'355	USD	450.09	5'060'662.42	0.66 a)
US0378331005	APPLE INC	88'717	124'528	41'362	171'883	USD	170.77	26'712'206.14	3.49 a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	64'162	58'325	46'584	75'903	USD	132.35	9'142'145.75	1.20 a)
US0476491081	ATKORE INC	93'544	44'512	49'320	88'736	USD	124.28	10'036'131.58	1.31 a)
US09062X1037	BIOGEN INC	0	19'179	4'338	14'841	USD	237.54	3'208'227.60	0.42 a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	0	2'127	152	1'975	USD	2'789.56	5'013'812.18	0.66 a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	0	216'092	45'082	171'010	USD	47.66	7'417'213.82	0.97 a)
US15135B1017	CENTENE CORP	134'055	51'952	104'231	81'776	USD	68.98	5'133'508.76	0.67 a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	133'122	31'318	164'440	0	USD	0.00	0.00	0.00
US2372661015	DARLING INGREDIENTS INC	61'484	52'495	113'979	0	USD	0.00	0.00	0.00
US2441991054	DEERE & CO	22'909	7'937	12'166	18'680	USD	365.36	6'211'022.81	0.81 a)
US27579R1041	EAST WEST BANCORP INC	146'670	38'815	185'485	0	USD	0.00	0.00	0.00
US2786421030	EBAY INC	131'459	34'268	165'727	0	USD	0.00	0.00	0.00
US29261A1007	ENCOMPASS HEALTH CORP	43'938	52'028	29'339	66'627	USD	62.56	3'793'256.87	0.50 a)
US29332G1022	ENHABIT INC	23'487	0	23'487	0	USD	0.00	0.00	0.00
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	62'640	17'656	80'296	0	USD	0.00	0.00	0.00
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	30'005	0	30'005	0	USD	0.00	0.00	0.00
US3364331070	FIRST SOLAR INC	103'651	56'940	82'183	78'408	USD	142.45	10'164'548.30	1.33 a)
US34959E1091	FORTINET INC	0	87'753	5'768	81'985	USD	57.17	4'265'479.38	0.56 a)
US3687361044	GENERAC HOLDINGS INC	46'808	8'690	55'498	0	USD	0.00	0.00	0.00
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	0	188'165	12'290	175'875	USD	78.54	12'570'723.14	1.64 a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	26'951	880	27'831	0	USD	0.00	0.00	0.00
US4932671088	KEYCORP	232'603	74'718	307'321	0	USD	0.00	0.00	0.00
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	78'870	34'619	68'131	45'358	USD	122.05	5'037'985.75	0.66 a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	58'632	73'409	21'534	110'507	USD	119.64	12'031'823.36	1.57 a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	0	52'926	19'604	33'322	USD	553.93	16'797'753.37	2.20 a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	52'084	33'210	30'211	55'083	USD	190.57	9'552'947.11	1.25 a)
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	66'517	38'388	30'926	73'979	USD	189.65	12'768'108.29	1.67 a)
US5763231090	MASTEC INC	0	43'709	43'709	0	USD	0.00	0.00	0.00
US5949181045	MICROSOFT CORP	146'978	71'732	71'095	147'615	USD	338.11	45'420'693.47	5.94 a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	113'628	70'823	47'250	137'201	USD	66.87	8'349'372.82	1.09 a)
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	231'719	39'268	270'987	0	USD	0.00	0.00	0.00
US67066G1040	NVIDIA CORP	61'891	35'043	30'066	66'868	USD	407.80	24'815'944.50	3.25 a)
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	0	75'887	75'887	0	USD	0.00	0.00	0.00
US6907421019	OWENS CORNING	101'439	59'384	46'532	114'291	USD	113.37	11'791'673.17	1.54 a)
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	25'541	835	26'376	0	USD	0.00	0.00	0.00
US7170811035	PFIZER INC	243'485	36'571	280'056	0	USD	0.00	0.00	0.00
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	30'411	15'241	13'375	32'277	USD	349.31	10'260'521.51	1.34 a)
US78486Q1013	SVB FINANCIAL GROUP	6'647	0	6'647	0	USD	0.00	0.00	0.00
US8716071076	SYNOPSIS INC	0	30'203	1'779	28'424	USD	469.44	12'143'127.10	1.59 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	83'286	13'860	69'426 USD	143.86	9'089'237.55	1.19	a)
US88160R1014	TESLA INC	35'782	21'829	14'102	43'509 USD	200.84	7'952'333.20	1.04	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29'715	17'282	16'442	30'555 USD	444.77	12'367'531.59	1.62	a)
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	68'666	19'752	31'214	57'204 USD	192.56	10'024'384.80	1.31	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	36'525	13'116	29'320	20'321 USD	406.27	7'513'202.32	0.98	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	40'098	17'020	17'492	39'626 USD	535.56	19'313'172.61	2.53	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	319'254	24'938	344'192	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	49'990	21'834	19'985	51'839 USD	362.11	17'082'931.03	2.23	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	43'790	34'040	15'219	62'611 USD	235.10	13'395'795.94	1.75	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	26'048	30'007	16'960	39'095 USD	164.33	5'846'599.25	0.76	a)
US							484'877'665.63	63.42	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
NL00150016G8	UNILEVER PLC-RIGHT	0	3'171	3'171	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001BD9	UNILEVER PLC	0	328'202	328'202	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001F19	UNILEVER PLC-DRIP	0	358'985	358'985	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001L26	UNILEVER PLC	0	355'881	355'881	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte									
CHF/SGD	Verfall 04.11.2022		450'000	317'960	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 07.11.2022		570'000	51'557	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 07.11.2022		700'000	494'225	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 10.11.2022		6'500'000	4'152'545	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 18.11.2022		19'000'000	129'196	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 29.11.2022		1'700'000	1'084'593	AUD/CHF		0.00	0.00	
DKK/JPY	Verfall 01.12.2022		39'000'000	2'006'854	JPY/DKK		0.00	0.00	
EUR/AUD	Verfall 19.12.2022		750'000	483'339	AUD/EUR		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 28.12.2022		920'000	631'886	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 29.12.2022		620'000	385'032	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 12.01.2023		61'000	38'866	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 12.01.2023		76'000'000	530'190	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 12.01.2023		120'000	82'989	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.01.2023		112'000'000	784'955	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.02.2023		222'000'000	1'576'673	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 03.02.2023		530'000	371'984	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.02.2023		355'000	230'122	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.02.2023		320'000	207'617	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 06.02.2023		320'000	223'334	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 09.02.2023		130'000	90'934	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 09.02.2023		42'500'000	297'217	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 15.02.2023		65'000	41'652	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 15.02.2023		56'000'000	394'675	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.03.2023		1'580'000	1'000'687	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 04.04.2023		410'000	282'087	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.04.2023		21'000'000	144'620	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 12.04.2023		485'000	294'153	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 21.04.2023		180'000	121'259	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 21.04.2023		69'000'000	461'794	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 28.04.2023		1'800'000	1'063'841	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 09.05.2023		1'250'000	739'605	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 09.05.2023		870'000	581'057	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 10.05.2023		117'700'000	774'958	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 16.05.2023		1'100'000	659'561	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.05.2023		360'000'000	2'400'271	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 26.05.2023		20'000	13'377	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.06.2023		500'000	294'619	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.06.2023		420'000'000	2'712'192	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 05.06.2023		405'000	270'772	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 15.06.2023		8'000	4'901	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.07.2023		1'000'000	599'102	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.07.2023		1'400'000	948'188	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.07.2023		260'000'000	1'615'731	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 06.07.2023		780'000	518'277	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.07.2023		25'000'000	22'432'875	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 13.07.2023		40'000'000	250'690	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 13.07.2023		105'000	62'052	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 13.07.2023		80'000	52'713	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 26.07.2023		117'500'000	717'988	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 28.07.2023		51'300'000	315'302	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.08.2023		57'000'000	349'971	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 08.08.2023		350'000	228'375	SGD/CHF		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF Verfall 02.12.2022	3'395'344	4'642'000	CHF/CAD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 02.12.2022	2'632'782	29'115'000	CHF/SEK	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 02.12.2022	2'538'330	19'123'000	CHF/DKK	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 02.12.2022	5'709'788	848'058'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.12.2022	11'739'073	11'883'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 02.12.2022	2'350'656	2'045'000	CHF/GBP	0.00	0.00
SGD/CHF Verfall 02.12.2022	1'591'320	2'257'000	CHF/SGD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.12.2022	79'724'816	79'932'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 02.12.2022	165'000	120'798	CAD/CHF	0.00	0.00
SGD/CHF Verfall 02.12.2022	124'649	177'000	CHF/SGD	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 02.12.2022	160'623	1'210'000	CHF/DKK	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.12.2022	3'332'000	3'362'614	USD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 02.12.2022	138'167	122'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.12.2022	525'423	532'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 02.12.2022	673'010	1'053'000	CHF/AUD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 02.12.2022	120'108	1'319'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 02.12.2022	629'000	461'074	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK Verfall 02.12.2022	3'086'000	282'619	SEK/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.12.2022	312'123	317'000	CHF/EUR	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 02.12.2022	156'054	1'179'000	CHF/DKK	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 02.12.2022	296'595	43'536'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 02.12.2022	74'496	66'000	CHF/GBP	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 02.12.2022	49'991	551'000	CHF/SEK	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.12.2022	980'652	1'011'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.12.2022	4'421'570	4'681'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.12.2022	610'888	626'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 02.12.2022	178'125	279'000	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 02.12.2022	921'127	936'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/DKK Verfall 02.12.2022	512'000	67'775	DKK/CHF	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 02.12.2022	360'745	52'930'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.01.2023	63'333'044	66'782'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 04.01.2023	11'403'377	11'644'000	CHF/EUR	0.00	0.00
SGD/CHF Verfall 04.01.2023	1'585'081	2'290'000	CHF/SGD	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 04.01.2023	793'819	1'248'000	CHF/AUD	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 04.01.2023	2'177'525	16'538'000	CHF/DKK	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 04.01.2023	2'150'924	1'902'000	CHF/GBP	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 04.01.2023	2'183'714	24'494'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 04.01.2023	2'311'284	3'302'000	CHF/CAD	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 04.01.2023	181'679	1'373'000	CHF/DKK	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 04.01.2023	816'037	829'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.01.2023	2'613'677	2'791'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 04.01.2023	472'000	464'344	EUR/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 04.01.2023	65'200	103'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 04.01.2023	72'000	48'958	CAD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 04.01.2023	298'334	261'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/SGD Verfall 04.01.2023	232'000	158'736	SGD/CHF	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 04.01.2023	166'096	1'257'000	CHF/DKK	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 04.01.2023	175'063	1'936'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CHF/DKK Verfall 04.01.2023	746'000	99'128	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 04.01.2023	810'000	800'514	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 04.01.2023	160'000	181'438	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK Verfall 04.01.2023	1'018'000	91'388	SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.01.2023	3'069'000	2'857'184	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 04.01.2023	55'000	61'415	GBP/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 04.01.2023	32'420	52'000	CHF/AUD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 04.01.2023	128'569	1'456'000	CHF/SEK	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 04.01.2023	3'230'000	2'205'347	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK Verfall 04.01.2023	18'422'000	2'445'889	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 04.01.2023	1'948'000	2'167'754	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD Verfall 04.01.2023	1'403'000	880'200	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD Verfall 04.01.2023	2'058'000	1'419'547	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.01.2023	66'504'000	61'524'846	USD/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 04.01.2023		816'594'000	5'725'549		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		11'191'000	11'049'658		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2023		26'868'000	2'385'610		SEK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		5'772'161	845'552'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2023		55'014'000	383'300		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2023		35'914'000	245'667		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		435'528	61'970'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		2'292'614	3'368'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		2'579'661	19'448'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		2'223'691	2'003'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		892'769	1'426'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		1'456'322	2'117'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		63'014'811	68'338'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'770'055	822'449'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		11'458'833	11'618'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		2'441'143	27'535'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		109'443	98'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		58'612	85'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		98'666	144'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		543'966	552'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		331'726	47'290'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		151'073	1'704'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		2'566'896	2'769'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		208'125	1'558'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		549'530	553'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		122'464	1'385'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2023		1'106'000	148'998		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		82'000	93'187		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2023		19'900'000	2'669'386		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		869'739'000	6'144'097		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		71'107'000	65'324'579		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2023		30'624'000	2'686'950		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		12'723'000	12'693'992		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2023		1'426'000	923'121		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2023		3'512'000	2'417'942		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		2'019'000	2'283'408		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2023		2'202'000	1'539'110		SGD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		2'659'533	19'848'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		6'650'031	940'681'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		67'205'038	73'379'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		2'785'966	31'800'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		12'854'824	12'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		2'503'015	3'646'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		988'533	1'530'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		2'324'154	2'060'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		1'614'018	2'315'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		11'101'682	12'179'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		399'437	4'559'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		303'525	270'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'849'940	1'855'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		353'757	517'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		875'707	123'725'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		380'850	2'841'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		149'790	232'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		221'015	318'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'326'908	1'334'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		186'450	271'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		110'840	159'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		587'523	84'061'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		134'607	121'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		248'433	1'859'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		174'760	2'003'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		5'285'330	5'710'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		69'709	109'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		349'866	2'640'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		92'000	103'218		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		3'185'000	2'955'333		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.03.2023		881'000	117'575		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.03.2023		2'763'000	248'601		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		1'148'467'000	7'902'831		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.03.2023		35'599'000	3'199'638		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		2'359'000	2'676'970		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		16'089'000	15'992'949		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		88'083'000	82'561'958		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 02.03.2023		26'307'000	3'513'563		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.03.2023		2'792'000	1'944'070		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		1'871'000	1'182'435		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		4'434'000	3'052'720		CAD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		7'835'772	1'137'629'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		2'943'221	32'810'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		2'624'688	2'320'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		15'238'849	15'356'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		78'286'203	83'827'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		3'456'843	25'919'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		1'851'658	2'667'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'276'651	2'025'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		2'864'078	4'174'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		178'822	283'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		204'218	1'520'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		67'410'000	465'338		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2023		108'000	75'340		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		2'291'000	2'081'790		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		1'482'000	126'984		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		559'000	548'371		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2023		108'000	73'450		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		113'000	125'685		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		88'000	53'713		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		42'628'000	295'722		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		1'607'000	141'954		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		980'000	86'336		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		133'000	81'791		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		645'490	649'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		882'278	885'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		137'712	1'029'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		230'509	204'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		139'763	1'584'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		98'300	143'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		2'087'000	1'276'827		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		30'325'000	2'671'329		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'027'591'000	7'052'974		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2023		4'174'000	2'817'325		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2023		2'594'000	1'782'234		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		16'331'000	16'207'211		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		2'411'000	2'723'128		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		81'536'000	74'481'505		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2023		28'468'000	3'792'792		DKK/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.05.2023		1'315'729	2'155'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.05.2023		2'724'846	30'980'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.05.2023		7'430'298	1'081'510'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.05.2023		2'904'060	4'314'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.05.2023		1'791'988	2'614'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2023		16'714'742	16'867'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2023		2'771'694	2'460'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.05.2023		76'688'226	84'208'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.05.2023		3'948'911	29'677'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.05.2023		89'824	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.05.2023		282'580	2'148'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2023		144'251	130'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2023		274'036	248'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.05.2023		167'821	284'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2023		1'183'593	1'204'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.05.2023		2'311'000	2'055'320		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.05.2023		34'414'000	229'833		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.05.2023		3'137'000	270'460		SEK/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2023		243'961	220'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.05.2023		2'677'000	2'401'323		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		1'047'096'000	6'842'406		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		79'220'000	70'512'058		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		4'314'000	2'831'063		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		2'614'000	1'743'930		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		18'071'000	17'756'908		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		3'058'000	3'421'015		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		31'825'000	4'195'378		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		27'843'000	2'415'798		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		2'589'000	1'522'811		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		6'967'490	1'065'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		74'517'291	84'019'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		2'994'054	4'576'000		CHF/CAD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		18'498'322	18'859'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		3'434'609	3'079'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		4'417'730	33'563'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		2'489'058	28'745'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		1'542'894	2'629'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		126'251	214'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		638'762	95'877'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		92'218	154'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		355'833	533'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		788'478	809'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		317'794	48'397'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		281'235	2'149'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		1'273'000	106'647		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		763'000	99'441		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		174'000	115'487		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		3'176'122	3'514'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		617'344	95'534'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		119'673	203'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		3'200'000	1'892'928		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		27'472'000	2'307'648		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		34'949'000	4'574'125		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		4'935'000	3'319'133		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		1'304'908'000	8'538'666		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		2'807'000	1'893'799		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		87'533'000	80'024'419		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		3'079'000	3'488'784		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		19'668'000	19'165'876		EUR/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		1'798'923	2'704'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		107'963	162'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2023		59'000	39'569		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		2'800'000	3'184'468		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		3'398'000	2'023'441		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		27'850'000	2'306'537		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.07.2023		1'299'135'000	8'040'866		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.07.2023		2'858'000	1'889'481		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		90'486'000	80'946'966		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		4'614'000	3'119'295		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.07.2023		22'804'000	2'989'148		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		18'820'000	18'370'767		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		1'923'983	3'261'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		2'248'854	26'827'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		4'526'243	34'639'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		3'228'013	4'814'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		8'511'569	1'299'135'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		1'923'297	2'858'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		79'273'522	87'049'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		3'431'606	3'038'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		19'473'637	20'022'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		200'000	134'543		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		1'202'000	1'166'055		EUR/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		121'137	1'455'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		3'227'000	420'194		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		1'119'000	146'516		DKK/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		184'574	2'201'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		3'107'168	3'437'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		2'068'000	271'135		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.07.2023		938'000	78'973		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		2'910'000	380'776		DKK/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		83'150	137'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.07.2023		1'695'000	142'224		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		123'000	140'342		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		115'000	130'418		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		2'511'000	329'948		DKK/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		3'214'388	2'834'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		2'036'358	3'427'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		2'314'903	27'998'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		8'246'607	1'330'540'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		1'854'796	2'811'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		82'804'105	92'837'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		3'211'088	4'762'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		3'019'162	23'062'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		18'310'393	18'787'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		200'750	177'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		337'654	2'576'000		CHF/DKK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		1'048'232	168'730'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		2'114'949	2'167'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		306'641	513'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		13'176'132	14'745'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		237'353	2'879'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		494'455	732'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		277'689	419'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		141'598	1'082'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		1'163'520	1'194'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		1'396'000	182'480		DKK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		4'186'537	4'871'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		210'808	190'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		2'211'000	183'933		SEK/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		167'529	2'012'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		119'348	183'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		200'695	305'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		124'358	213'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		25'324'000	3'247'550		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		4'153'000	2'425'767		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		112'453'000	97'475'385		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		30'678'000	2'530'628		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		3'201'000	3'569'883		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		1'499'270'000	9'146'746		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		5'799'000	3'818'873		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		22'148'000	21'166'844		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		3'413'000	2'228'041		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		4'171'000	2'385'854		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		5'627'000	3'673'699		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		3'164'000	3'540'959		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		29'073'000	2'344'737		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2023		1'575'663'000	9'559'863		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		20'533'000	19'681'907		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		115'669'000	102'160'017		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2023		27'470'000	3'533'466		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2023		3'402'000	2'224'840		SGD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		3'288'527	25'686'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		2'503'172	4'296'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		99'907'132	115'669'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		2'668'483	32'414'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		3'667'805	3'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		9'627'648	1'575'663'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		3'827'923	5'831'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		21'987'643	23'052'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		2'331'665	3'579'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		1'403'000	1'343'812		EUR/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		592'727	4'595'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.09.2023		2'811'000	360'567		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.09.2023		2'240'000	180'257		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		1'116'000	1'066'510		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2023		204'000	132'495		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2023		125'000	70'375		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.09.2023		177'000	114'848		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.09.2023		1'101'000	88'368		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2023		136'000	151'522		GBP/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'419'854	4'239'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		3'585'773	5'507'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		3'598'707	3'225'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		2'362'310	29'340'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		9'430'800	1'552'183'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		19'671'507	20'557'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		104'744'280	118'960'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		3'447'491	26'840'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		2'264'529	3'469'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		139'000	90'675		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		507'000	329'271		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		1'271'000	101'983		SEK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		478'383	78'678'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		361'469	2'800'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		4'070'000	3'673'672		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		235'000	157'140		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		1'429'000	118'443		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		241'000	163'701		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		20'557'000	19'911'510		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		1'630'861'000	9'998'156		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		114'890'000	105'107'117		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		3'225'000	3'601'067		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		26'640'000	2'242'822		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		3'330'000	2'231'766		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		29'640'000	3'849'940		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		4'239'000	2'503'053		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		4'524'000	3'061'210		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		19'650'976	20'328'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		9'409'952	1'532'503'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		2'281'224	27'150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		99'742'527	109'377'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		3'395'406	3'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		2'255'007	3'371'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		3'537'043	27'276'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		2'488'844	4'224'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'004'778	4'453'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		860'000	71'227		SEK/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		229'121	1'791'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		163'657	1'291'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		1'501'000	122'465		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		708'000	770'722		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		857'000	812'627		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		1'124'000	91'055		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		1'160'000	147'399		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		162'000	176'360		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		213'000	138'690		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		179'000	102'915		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		163'000	178'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		4'723'000	4'259'754		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		104'654'000	95'235'140		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		3'371'000	2'239'052		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		23'665'000	1'927'278		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		19'471'000	18'731'102		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		4'240'000	2'779'320		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		1'532'503'000	9'209'424		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		2'017'000	2'227'494		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		4'045'000	2'330'608		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		29'198'000	3'762'746		DKK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		95'838'243	105'675'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		18'071'398	18'825'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'942'071	23'898'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		2'327'344	3'511'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		9'203'874	1'529'119'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		2'966'491	4'539'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		1'275'845	1'159'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'413'073	4'198'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		3'969'259	30'857'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	42'701'360.57	5.59
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	721'058'396.34	94.32
Sonstige Vermögenswerte	754'567.10	0.10
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	764'514'324.01	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-214'851.61	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	764'299'472.40	

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);	721'058'396.34	94.32
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

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57619816
CAD	1 = CHF	0.65553755
DKK	100 = CHF	12.88776200
EUR	1 = CHF	0.96192671
GBP	1 = CHF	1.10430017
HKD	100 = CHF	11.63062600
HUF	100 = CHF	0.25122000
JPY	100 = CHF	0.60091100
NOK	100 = CHF	8.14603000
SEK	100 = CHF	8.14533700
SGD	1 = CHF	0.66424583
USD	1 = CHF	0.91005000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	138'396'213.53	18.108

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

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	-	-	-	-

6 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.

7 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: 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
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.

8 Benchmark

MSCI® World ex Switzerland Index TR Net

9 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.

10 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	0.84923	0.29723	0.55200
GT CHF	Ja	CHF	0.61223	0.21428	0.39795
MT CHF	Ja	CHF	1.848	0.646	1.202
NT CHF	Ja	CHF	30.862	10.801	20.061
NTH1 CHF	Ja	CHF	1.371	0.479	0.892

11 Sonderausschüttung 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Sonderausschüttung der ausländischen Quellensteuer

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	CHF	0.45000	0.15750	0.29250

12 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.

13 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"
(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

Zurzeit mit den 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 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)

(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, im Bereich Risikoverteilung anzupassen.

Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde die Anlagepolitik und die Risikoverteilung soweit möglich dem Musterfondsvertrag der Asset Management Association Switzerland angepasst und Bestimmungen in diesen Bereichen standardisiert, harmonisiert und vereinfacht. Mit dieser Fondsvertragsänderung waren keine Umschichtungen von Anlagen in den Teilvermögen und keine Änderung der effektiven Anlagepolitik der Teilvermögen verbunden.

Die Teilvermögen des Umbrella-Fonds werden in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv verwaltet. Diesem Sachverhalt trägt die Bestimmung von § 16 Ziff. 4 Rechnung. Darin ist festgehalten, dass wenn sich ein Teilvermögen an einem Referenzindex (Benchmark) orientiert, der Anteil desselben Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens die Limiten von § 16 Ziff. 3 übersteigen darf. Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde dem Umstand, dass dies für sämtliche Effekten und Geldmarktinstrumente Anwendung finden soll, nicht genügend Rechnung getragen. Entsprechend soll mit dieser Fondsvertragsüberarbeitung diese Bestimmung für sämtliche Effekten oder Geldmarktinstrumente desselben Emittenten gelten und somit auch bei den Obligationen-Teilvermögen zur Anwendung kommen.

Pfandbriefe der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale weisen gemäss Referenzindex der Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF einen Anteil von über 10% am Referenzindex auf. Bei beiden Teilvermögen beträgt der Anteil in Pfandbriefen der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale ebenfalls über 10% des Vermögens der Teilvermögen. Mit der Erweiterung in § 16 Ziff. 4 von ehemals Beteiligungswertpapieren und -wertrechten auf neu Effekten oder Geldmarktinstrumente wird fortan diese Bestimmung die Emittentenbegrenzung definieren. Aktuell kommt die Gesamtbeschränkung von § 16 Ziff. 7 zur Anwendung. Diese beinhaltet, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen desselben Emittenten bzw. Schuldner insgesamt 20% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen darf.

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 umschriebene Änderung des Fondsvertrags 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 10. November 2022

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 "Übriger Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den 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)

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Die Anlagepolitik der nachstehend aufgeführten Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 5 B Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 C Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 D Bst. d, § 8 Ziff. 5 E Bst. d, § 8 Ziff. 5 F Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 G Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 H Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 I Bst. d, § 8 Ziff. 5 J Bst. d und § 8 Ziff. 5 K Bst. a und c des Fondsvertrages präzisiert werden.

In den erwähnten Bestimmungen werden bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf eine andere Währung als den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 C Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind,

wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (§ 8 Ziff. 5 C Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 D Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 E Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten und mit Bonität Investment Grade (Mindestrating BBB- oder gleichwertig), zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 I Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 J Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. c).

* * *

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 Fondsvertrages 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, 22. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich