

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE CHF

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

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	22
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
7	Pauschale Verwaltungskommission	24
8	Benchmark	24
9	TER	24
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
12	Fussnoten	25
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26
14	Pflichtpublikationen	28

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		3'596'400'249.72	2'131'455'556.11	1'745'881'904.78	930'744'064.54
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'337'269.13	4'826'328.12	3'416'901.37	3'480'310.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		126'810.422	55'485.112	35'052.404	34'748.404
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.4033	86.9842	97.4798	100.1574
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.1619	87.2626	97.4018	100.4479
Ausschüttung je Anteil		0.15	-	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.88 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'753'943.43	3'044'523.12	3'994'462.10	3'688'551.11
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		61'917.705	33'706.366	39'588.963	35'554.884
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.9289	90.3249	100.8984	103.7425
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.6780	90.6139	100.8177	104.0433
Ausschüttung je Anteil		0.50	0.20	-	0.40
Total Expense Ratio (TER)		0.53 %	0.53 %	0.53 %	0.54 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		30'922'435.08	25'351'514.92	23'296'438.28	19'076'715.01
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		335'021.005	283'185.260	232'944.513	186'211.721
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.3000	89.5227	100.0085	102.4464
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.0508	89.8092	99.9285	102.7435
Thesaurierung je Anteil		0.50	0.12	0.12	0.16
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		191'667'885.81	144'122'027.50	127'993'786.47	46'260'191.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'983'477.076	1'538'589.351	1'223'850.038	432'081.842
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.6323	93.6715	104.5829	107.0635
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.3714	93.9713	104.4992	107.3740
Thesaurierung je Anteil		0.61	0.21	0.23	0.25
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'136'619'465.64	1'475'121'714.79	1'132'914'429.11	484'064'442.17
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'005'430.022	16'387'031.175	11'273'849.216	4'705'742.052
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.8746	90.0176	100.4905	102.8668
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.6238	90.3057	100.4101	103.1651
Thesaurierung je Anteil		0.61	0.22	0.24	0.28
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %

	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
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'220'099'250.63	478'989'447.66	454'265'887.45	374'173'853.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'044'762.292	424'188.090	361'248.054	291'399.482
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'167.8247	1'129.1912	1'257.4902	1'284.0581
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'164.6716	1'132.8046	1'256.4842	1'287.7818
Thesaurierung je Anteil		12.04	7.41	7.87	8.33
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

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	2.18 %	-12.35 %	-2.51 %	1.19 %
Klasse BA CHF	2.50 %	-12.07 %	-2.19 %	0.77 %
Klasse CT CHF	2.54 %	-12.04 %	-2.15 %	0.31 %
Klasse DT CHF	3.24 %	-11.68 %	-2.07 %	0.80 %
Klasse GT CHF	3.27 %	-11.66 %	-2.05 %	0.69 %
Klasse NT CHF	3.66 %	-11.32 %	-1.67 %	0.64 %
Benchmark	2.99 %	-12.10 %	-1.82 %	0.90 %
Tracking Error 33)	0.51 %	0.60 %	0.27 %	0.32 %

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	-0.81 %
Klasse BA CHF	-0.49 %
Klasse CT CHF	-0.45 %
Klasse DT CHF	0.25 %
Klasse GT CHF	0.28 %
Klasse NT CHF	0.67 %

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 Klassen-währungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2023	31.10.2022
Bankguthaben auf Sicht	59'751'597.78	4'091'126.15
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'513'839'028.18	2'109'144'160.00
Derivative Finanzinstrumente	-891'101.55	8'865'282.25
Sonstige Vermögenswerte	24'499'529.17	9'889'237.52
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'597'199'053.58	2'131'989'805.92
Andere Verbindlichkeiten	-798'803.86	-534'249.81
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'596'400'249.72	2'131'455'556.11

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		55'485.112	35'052.404
Ausgegebene Anteile		99'102.470	27'696.854
Zurückgenommene Anteile		-27'777.160	-7'264.146
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		126'810.422	55'485.112
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		33'706.366	39'588.963
Ausgegebene Anteile		37'402.986	8'819.403
Zurückgenommene Anteile		-9'191.647	-14'702.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		61'917.705	33'706.366
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		283'185.260	232'944.513
Ausgegebene Anteile		103'601.240	80'868.786
Zurückgenommene Anteile		-51'765.495	-30'628.039
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		335'021.005	283'185.260
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'538'589.351	1'223'850.038
Ausgegebene Anteile		2'005'436.716	505'150.110
Zurückgenommene Anteile		-1'560'548.991	-190'410.797
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'983'477.076	1'538'589.351
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'387'031.175	11'273'849.216
Ausgegebene Anteile		10'917'813.238	7'822'020.902
Zurückgenommene Anteile		-4'299'414.391	-2'708'838.943
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		23'005'430.022	16'387'031.175
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		424'188.090	361'248.054
Ausgegebene Anteile		622'357.474	106'825.968
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		40'156.147	4'651.862
Zurückgenommene Anteile		-41'939.419	-48'537.794
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'044'762.292	424'188.090

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	17.01.2023	46'582'724.72	40'156.147

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		2'131'455'556.11	1'745'881'904.78
Ausbezahlte Ausschüttung		-9'288.97	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'168'786.54	-2'188'823.11
Saldo aus dem Anteilverkehr		1'367'474'013.54	595'606'669.45
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		101'648'755.58	-207'844'195.01
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'596'400'249.72	2'131'455'556.11

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		85'368.90	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-220'988.40
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		33'586'578.60	12'463'106.39
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'151'380.39	1'149'668.58
Total Ertrag		37'823'327.89	13'391'786.57
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-8'427'938.01	-5'638'229.58
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'284'242.32	-496'501.59
Total Aufwand		-9'712'180.33	-6'134'731.17
Nettoertrag / Verlust		28'111'147.56	7'257'055.40
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-42'872'023.66	-28'387'699.02
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		4'523'637.87	1'813'889.12
Realisierter Erfolg		-10'237'238.23	-19'316'754.50
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		111'885'993.81	-188'527'440.51
Gesamterfolg		101'648'755.58	-207'844'195.01

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	23'395.44	-11'311.36
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	0.00	11'311.36
Vortrag des Vorjahres	919.55	919.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	24'314.99	919.55
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	19'021.56	0.00
Vortrag auf neue Rechnung	5'293.43	919.55
Total	24'314.99	919.55
Klasse BA CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	30'185.56	2'061.01
Vortrag des Vorjahres	907.27	5'587.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	31'092.83	7'648.54
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	30'958.85	6'741.27
Vortrag auf neue Rechnung	133.98	907.27
Total	31'092.83	7'648.54
Klasse CT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	170'249.88	34'845.76
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	170'249.88	34'845.76
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	59'587.46	12'196.02
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	110'662.42	22'649.74
Total	170'249.88	34'845.76
Klasse DT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	1'224'906.83	335'786.51
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'224'906.83	335'786.51
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	428'717.39	117'525.28
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	796'189.44	218'261.23
Total	1'224'906.83	335'786.51
Klasse GT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	14'074'706.79	3'749'887.16
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	14'074'706.79	3'749'887.16
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'926'147.38	1'312'460.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	9'148'559.41	2'437'426.65
Total	14'074'706.79	3'749'887.16
Klasse NT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	12'587'703.06	3'145'786.32
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12'587'703.06	3'145'786.32
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'405'696.07	1'101'025.21
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'182'006.99	2'044'761.11
Total	12'587'703.06	3'145'786.32

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							3'513'839'028.18	97.68		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							3'513'839'028.18	97.68		
CH0433761282	0.3225 % FABUH 0.3225 09/27/23 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	93.15%	2'142'450.00	0.06	a)	
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	94.25%	6'597'500.00	0.18	a)	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	97.45%	4'872'500.00	0.14	a)	
AE							13'612'450.00	0.38		
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	2'150	0	0	2'150 CHF	108.95%	2'342'425.00	0.07	a)	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'240	0	0	1'240 CHF	117.60%	1'458'240.00	0.04	a)	
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	7'500	1'200	0	8'700 CHF	101.00%	8'787'000.00	0.24	a)	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	85.00%	2'125'000.00	0.06	a)	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	8'500	5'000	3'500 CHF	101.15%	3'540'250.00	0.10	a)	
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	0	3'000	0	3'000 CHF	101.30%	3'039'000.00	0.08	a)	
AT							21'291'915.00	0.59		
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMTN	4'000	3'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	5'350	0	5'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'000	0	4'000	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	97.00%	4'850'000.00	0.13	a)	
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	4'500	750	0	5'250 CHF	99.33%	5'214'825.00	0.14	a)	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.80%	978'000.00	0.03	a)	
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	500	4'000	2'000	2'500 CHF	99.02%	2'475'500.00	0.07	a)	
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	95.60%	1'434'000.00	0.04	a)	
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	500	3'500	500	3'500 CHF	94.35%	3'302'250.00	0.09	a)	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	89.25%	2'677'500.00	0.07	a)	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	1'000	2'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.30%	1'806'000.00	0.05	a)	
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	6'140	0	0	6'140 CHF	98.60%	6'054'040.00	0.17	a)	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	98.95%	9'895'000.00	0.28	a)	
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	5'000	0	5'000 CHF	101.75%	5'087'500.00	0.14	a)	
AU							43'774'615.00	1.22		
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	0	1'000	0	1'000 CHF	89.20%	892'000.00	0.02	a)	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	2'500	500	0	3'000 CHF	93.25%	2'797'500.00	0.08	a)	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.56%	487'800.00	0.01	a)	
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	3'000	1'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0426621709	0.1500 % CM 0.15 07/31/23 EMTN	4'000	2'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	250	0	0	250 CHF	97.05%	242'625.00	0.01	a)	
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.30%	943'000.00	0.03	a)	
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	2'500	0	0	2'500 CHF	86.85%	2'171'250.00	0.06	a)	
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	7'500	0	3'000	4'500 CHF	94.40%	4'248'000.00	0.12	a)	
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	5'000	6'000	0	11'000 CHF	89.60%	9'856'000.00	0.27	a)	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	9'500	1'500	0	11'000 CHF	90.65%	9'971'500.00	0.28	a)	
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	2'500	0	1'500	1'000 CHF	91.25%	912'500.00	0.03	a)	
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	0	3'200	0	3'200 CHF	97.90%	3'132'800.00	0.09	a)	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	5'000	2'500	0	7'500 CHF	94.85%	7'113'750.00	0.20	a)	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00		
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.15%	10'115'000.00	0.28	a)	
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	0	10'000	2'000	8'000 CHF	101.65%	8'132'000.00	0.23	a)	
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.80%	5'040'000.00	0.14	a)	
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	5'500	0	5'500 CHF	100.25%	5'513'750.00	0.15	a)	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.90%	10'190'000.00	0.28	a)	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	20'000	0	20'000 CHF	101.70%	20'340'000.00	0.57	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.
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.05%	2'021'000.00	0.06	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	102.50%	6'150'000.00	0.17	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	3'000	0	3'000 CHF	103.00%	3'090'000.00	0.09	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	14'500	0	14'500 CHF	100.70%	14'601'500.00	0.41	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.85%	5'042'500.00	0.14	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.14	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.35%	5'067'500.00	0.14	a)
CA							143'151'975.00	3.98	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	10'000	10'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	2'650	0	2'000	650 CHF	161.50%	1'049'750.00	0.03	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	5'000	0	0	5'000 CHF	101.51%	5'075'500.00	0.14	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	0	2'000	0	2'000 CHF	115.37%	2'307'400.00	0.06	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	17'000	6'000	0	23'000 CHF	100.65%	23'149'500.00	0.64	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	10'000	17'500	17'500	10'000 CHF	107.73%	10'773'000.00	0.30	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'215	0	0	1'215 CHF	101.31%	1'230'916.50	0.03	a)
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	2'000	0	0	2'000 CHF	103.35%	2'067'000.00	0.06	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	4'000	10'000	14'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	3'000	7'000	0	10'000 CHF	101.30%	10'130'000.00	0.28	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	300	12'500	12'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	6'500	57'500	16'000	48'000 CHF	102.70%	49'296'000.00	1.37	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	0	5'000	2'500	2'500 CHF	100.16%	2'504'000.00	0.07	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	1'000	8'400	5'000	4'400 CHF	106.50%	4'686'000.00	0.13	a)
CH0126183075	2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	0	18'000	15'000	3'000 CHF	102.24%	3'067'200.00	0.09	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	0	30'000	5'000	25'000 CHF	108.88%	27'220'000.00	0.76	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	1'500	0	0	1'500 CHF	104.94%	1'574'100.00	0.04	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	6'825	20'000	24'350	2'475 CHF	101.02%	2'500'245.00	0.07	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	0	2'000	0	2'000 CHF	99.92%	1'998'400.00	0.06	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	240	0	0	240 CHF	99.79%	239'496.00	0.01	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	1'000	6'000	0	7'000 CHF	99.87%	6'990'900.00	0.19	a)
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	4'000	3'000	3'000	4'000 CHF	99.98%	3'999'200.00	0.11	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	3'000	0	2'000	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.03	a)
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	12'500	0	4'700	7'800 CHF	99.85%	7'788'300.00	0.22	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	0	6'200	0	6'200 CHF	99.75%	6'184'500.00	0.17	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	700	0	0	700 CHF	100.00%	700'000.00	0.02	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	1'000	3'000	3'000	1'000 CHF	99.88%	998'800.00	0.03	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	4'000	0	0	4'000 CHF	99.47%	3'978'800.00	0.11	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	3'200	6'800	0	10'000 CHF	99.63%	9'963'000.00	0.28	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	800	10'500	11'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	0	6'000	0	6'000 CHF	99.58%	5'974'800.00	0.17	a)
CH0188335365	1.7500 % SCMNVDX 1 3/4 07/10/24	5'090	2'000	0	7'090 CHF	99.90%	7'082'910.00	0.20	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'000	0	0	1'000 CHF	99.40%	994'000.00	0.03	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	14'000	0	7'500	6'500 CHF	97.90%	6'363'500.00	0.18	a)
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	3'280	4'000	7'280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	0	1'000	0	1'000 CHF	99.35%	993'500.00	0.03	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	1'750	16'950	0	18'700 CHF	99.52%	18'610'240.00	0.52	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	10'000	0	3'000	7'000 CHF	102.00%	7'140'000.00	0.20	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	4'000	4'000	0	8'000 CHF	101.65%	8'132'000.00	0.23	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	750	0	0	750 CHF	99.84%	748'800.00	0.02	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.
CH0212184078	1.8750 % SLHNX 1 7/8 06/21/23	7'600	4'300	11'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'135	0	0	2'135 CHF	100.60%	2'147'810.00	0.06	a)
CH0214926088	1.6250 % EMMI 1 5/8 07/12/23	0	4'740	4'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	0	4'600	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	0	10'000	0	10'000 CHF	101.90%	10'190'000.00	0.28	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	1'400	0	0	1'400 CHF	104.70%	1'465'800.00	0.04	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH02222705987	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/18/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	5'000	12'500	17'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	8'000	0	0	8'000 CHF	130.46%	10'436'800.00	0.29	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	5'000	28'380	33'380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	11'050	0	2'500	8'550 CHF	83.94%	7'176'870.00	0.20	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	0	4'000	0	4'000 CHF	104.55%	4'182'000.00	0.12	a)
CH0224761517	1.8750 % SIKASW 1 7/8 11/14/23	0	7'500	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	900	2'500	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	0	3'000	0	3'000 CHF	98.35%	2'950'500.00	0.08	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'000	0	0	4'000 CHF	99.89%	3'995'600.00	0.11	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	1'750	1'500	0	3'250 CHF	100.13%	3'254'225.00	0.09	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	6'475	6'000	0	12'475 CHF	99.85%	12'456'287.50	0.35	a)
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	0	12'000	0	12'000 CHF	99.89%	11'986'800.00	0.33	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	0	2'000	0	2'000 CHF	99.56%	1'991'200.00	0.06	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'050	0	0	1'050 CHF	99.55%	1'045'275.00	0.03	a)
CH0246920208	1.1250 % KBLUZE 1 1/8 06/30/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	1'000	0	2'000 CHF	99.75%	1'995'000.00	0.06	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	0	4'700	0	4'700 CHF	101.15%	4'754'050.00	0.13	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMNVS 1 1/2 07/14/26	1'500	0	0	1'500 CHF	99.65%	1'494'750.00	0.04	a)
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	0	1'800	0	1'800 CHF	99.88%	1'797'840.00	0.05	a)
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	4'810	0	4'810	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	97.60%	976'000.00	0.03	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	3'000	11'000	0	14'000 CHF	99.27%	13'897'800.00	0.39	a)
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	0	3'000	0	3'000 CHF	99.48%	2'984'400.00	0.08	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	0	3'000	0	3'000 CHF	99.13%	2'973'900.00	0.08	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	10'000	10'000	0	20'000 CHF	97.70%	19'540'000.00	0.54	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'575	0	0	1'575 CHF	98.45%	1'550'587.50	0.04	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	0	3'000	2'000	1'000 CHF	99.49%	994'900.00	0.03	a)
CH0254147504	1.5000 % SCMNVS 1 1/2 09/28/29	7'250	0	7'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	1'000	1'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	4'000	1'000	0	5'000 CHF	97.05%	4'852'500.00	0.13	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	0	1'740	0	1'740 CHF	99.06%	1'723'644.00	0.05	a)
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	550	0	0	550 CHF	96.70%	531'850.00	0.01	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	0	1'800	0	1'800 CHF	97.86%	1'761'480.00	0.05	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	2'750	5'600	0	8'350 CHF	99.02%	8'268'170.00	0.23	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	2'000	1'000	0	3'000 CHF	99.01%	2'970'300.00	0.08	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	7'425	0	5'000	2'425 CHF	97.40%	2'361'950.00	0.07	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	4'000	3'000	0	7'000 CHF	98.69%	6'908'300.00	0.19	a)
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	2'900	29'800	0	32'700 CHF	97.31%	31'820'370.00	0.88	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	5'000	0	0	5'000 CHF	92.70%	4'635'000.00	0.13	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	2'500	0	0	2'500 CHF	98.02%	2'450'500.00	0.07	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	3'325	0	2'000	1'325 CHF	92.59%	1'226'817.50	0.03	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	5'715	0	1'000	4'715 CHF	94.00%	4'432'100.00	0.12	a)
CH0268988174	0.2500 % SCMNVS 0 1/4 04/17/23	2'500	2'500	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268988182	1.0000 % SCMNVS 1 04/17/35	3'500	0	0	3'500 CHF	90.45%	3'165'750.00	0.09	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	7'500	0	0	7'500 CHF	93.75%	7'031'250.00	0.20	a)
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	0	4'000	0	4'000 CHF	91.05%	3'642'000.00	0.10	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	0	5'400	0	5'400 CHF	94.00%	5'076'000.00	0.14	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	0	1'000	0	1'000 CHF	98.70%	987'000.00	0.03	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	0	3'000	0	3'000 CHF	94.70%	2'841'000.00	0.08	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	600	1'500	0	2'100 CHF	96.15%	2'019'150.00	0.06	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'000	5'500	7'500	0 CHF	0.00%	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.
CH0276237663	0.3000 % GEBNVX 0.3 04/17/23	1'500	6'500	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	1'500	0	1'000	500 CHF	90.30%	451'500.00	0.01 a)	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135310	0.2500 % SGSNVX 0 1/4 05/08/23	7'500	5'025	12'525	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	2'000	500	0	2'500 CHF	97.75%	2'443'750.00	0.07 a)	
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	2'500	1'000	0	3'500 CHF	89.08%	3'117'800.00	0.09 a)	
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	5'000	0	4'000	1'000 CHF	84.89%	848'900.00	0.02 a)	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	2'000	6'500	8'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	5'350	1'400	6'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	3'500	3'000	0	6'500 CHF	96.65%	6'282'250.00	0.17 a)	
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	1'000	0	0	1'000 CHF	91.35%	913'500.00	0.03 a)	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	3'500	0	2'000	1'500 CHF	92.46%	1'386'900.00	0.04 a)	
CH0293173453	1.2500 % LONNVX 1 1/4 09/22/23	1'560	2'645	4'205	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	3'250	500	3'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	17'955	0	0	17'955 CHF	90.65%	16'276'207.50	0.45 a)	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	1'500	1'000	0	2'500 CHF	98.25%	2'456'250.00	0.07 a)	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	0	4'500	0	4'500 CHF	94.20%	4'239'000.00	0.12 a)	
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	1'500	0	0	1'500 CHF	98.26%	1'473'900.00	0.04 a)	
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	2'000	0	0	2'000 CHF	89.40%	1'788'000.00	0.05 a)	
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	3'500	0	1'000	2'500 CHF	92.55%	2'313'750.00	0.06 a)	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	3'500	0	1'000	2'500 CHF	94.64%	2'366'000.00	0.07 a)	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	2'000	4'000	2'500	3'500 CHF	99.48%	3'481'800.00	0.10 a)	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	20'000	0	4'000	16'000 CHF	86.60%	13'856'000.00	0.39 a)	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	2'500	1'500	0	4'000 CHF	96.55%	3'862'000.00	0.11 a)	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	1'000	0	1'000 CHF	94.15%	941'500.00	0.03 a)	
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	0	5'000	0	5'000 CHF	99.10%	4'955'000.00	0.14 a)	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	0	1'400	0	1'400 CHF	85.80%	1'201'200.00	0.03 a)	
CH0317921663	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 03/31/28	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	3'250	0	0	3'250 CHF	95.65%	3'108'625.00	0.09 a)	
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	9'300	0	0	9'300 CHF	89.75%	8'346'750.00	0.23 a)	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	2'000	0	0	2'000 CHF	85.53%	1'710'600.00	0.05 a)	
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	1'700	0	0	1'700 CHF	94.35%	1'603'950.00	0.04 a)	
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	0	3'000	0	3'000 CHF	77.25%	2'317'500.00	0.06 a)	
CH0330143170	0.0000 % PSPNSW 0 09/01/23	750	10'250	11'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'500	500	0	3'000 CHF	94.10%	2'823'000.00	0.08 a)	
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	2'000	0	0	2'000 CHF	89.05%	1'781'000.00	0.05 a)	
CH0331455326	0.0000 % KTBS 0 09/05/23	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	2'500	0	0	2'500 CHF	77.45%	1'936'250.00	0.05 a)	
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	0	15'750	0	15'750 CHF	72.53%	11'423'475.00	0.32 a)	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	2'000	0	2'000 CHF	98.87%	1'977'400.00	0.05 a)	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	4'500	3'500	4'000	4'000 CHF	95.14%	3'805'600.00	0.11 a)	
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	0	3'500	1'000	2'500 CHF	88.41%	2'210'250.00	0.06 a)	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	3'500	3'000	3'000	3'500 CHF	95.55%	3'344'250.00	0.09 a)	
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	5'000	0	0	5'000 CHF	86.65%	4'332'500.00	0.12 a)	
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	2'000	5'000	0	7'000 CHF	75.60%	5'292'000.00	0.15 a)	
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	3'145	0	0	3'145 CHF	82.00%	2'578'900.00	0.07 a)	
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	500	0	0	500 CHF	76.75%	383'750.00	0.01 a)	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	4'100	0	0	4'100 CHF	95.30%	3'907'300.00	0.11 a)	
CH0343366776	0.0000 % GIVNVX 0 12/07/22	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'600	0	0	1'600 CHF	88.65%	1'418'400.00	0.04 a)	
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	17'500	0	17'500 CHF	98.25%	17'193'750.00	0.48 a)	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	0	5'250	5'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	4'000	1'000	0	5'000 CHF	83.23%	4'161'500.00	0.12 a)	
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	15'000	3'000	7'500	10'500 CHF	86.58%	9'090'900.00	0.25 a)	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	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.
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'450	0	0	1'450 CHF	95.05%	1'378'225.00	0.04	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	0	2'000	0	2'000 CHF	95.62%	1'912'400.00	0.05	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	2'500	0	0	2'500 CHF	96.85%	2'421'250.00	0.07	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	3'950	0	3'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	750	0	0	750 CHF	98.31%	737'325.00	0.02	a)
CH0357483160	2.0000 % KWLILJ 2 12/11/23	0	2'000	0	2'000 CHF	99.96%	1'999'200.00	0.06	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	0	1'500	0	1'500 CHF	96.51%	1'447'650.00	0.04	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	15'050	0	0	15'050 CHF	98.45%	14'816'725.00	0.41	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	4'000	0	0	4'000 CHF	95.56%	3'822'400.00	0.11	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	6'050	0	6'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	0	3'945	0	3'945 CHF	98.78%	3'896'871.00	0.11	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	4'000	0	0	4'000 CHF	88.75%	3'550'000.00	0.10	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	6'000	1'000	5'000 CHF	99.31%	4'965'500.00	0.14	a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206692	0.5000 % GALESW 0 1/2 06/15/23	7'500	4'300	11'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	4'000	0	0	4'000 CHF	93.60%	3'744'000.00	0.10	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	0	5'900	0	5'900 CHF	94.59%	5'580'810.00	0.16	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476164	0.7500 % SCMNVS 0 3/4 11/24/33	2'800	0	0	2'800 CHF	89.20%	2'497'600.00	0.07	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	1'000	0	0	1'000 CHF	89.55%	895'500.00	0.02	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'000	0	0	3'000 CHF	94.60%	2'838'000.00	0.08	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	1'500	1'000	0	2'500 CHF	95.37%	2'384'250.00	0.07	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	2'000	5'500	0	7'500 CHF	97.00%	7'275'000.00	0.20	a)
CH0373476628	0.5000 % ALLNSW 0 1/2 04/19/23 0	13'000	2'000	15'000	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	97.75%	9'677'250.00	0.27	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	4'600	0	0	4'600 CHF	94.76%	4'358'960.00	0.12	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	5'000	0	0	5'000 CHF	92.70%	4'635'000.00	0.13	a)
CH0373476768	1.2500 % GRANDX 1 1/4 06/06/23	6'500	11'000	17'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	3'000	0	0	3'000 CHF	84.95%	2'548'500.00	0.07	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	4'000	0	1'500	2'500 CHF	96.40%	2'410'000.00	0.07	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	0	14'000	2'000	12'000 CHF	95.60%	11'472'000.00	0.32	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'600	6'000	0	7'600 CHF	92.35%	7'018'600.00	0.20	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	2'000	200	0	2'200 CHF	95.70%	2'105'400.00	0.06	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	2'000	0	0	2'000 CHF	94.50%	1'890'000.00	0.05	a)
CH0398633450	0.8750 % MOBSNW 0 7/8 10/02/23	0	5'960	5'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	8'000	0	0	8'000 CHF	91.79%	7'343'200.00	0.20	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	1'900	0	1'900 CHF	97.60%	1'854'400.00	0.05	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	0	3'000	2'000	1'000 CHF	97.50%	975'000.00	0.03	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'500	0	0	5'500 CHF	95.02%	5'226'100.00	0.15	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	0	2'250	0	2'250 CHF	88.40%	1'989'000.00	0.06	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	980	0	0	980 CHF	91.10%	892'780.00	0.02	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	3'000	4'000	0	7'000 CHF	97.00%	6'790'000.00	0.19	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	1'000	4'000	0	5'000 CHF	99.10%	4'955'000.00	0.14	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414510054	0.2500 % SCHPSW 0 1/4 06/05/23 MTN	2'950	5'000	7'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	0	5'000	0	5'000 CHF	90.60%	4'530'000.00	0.13	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	3'200	0	0	3'200 CHF	94.90%	3'036'800.00	0.08	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	3'000	10'000	3'000	10'000 CHF	96.75%	9'675'000.00	0.27	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	0	5'000	0	5'000 CHF	92.30%	4'615'000.00	0.13	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'000	0	0	1'000 CHF	86.50%	865'000.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	6'200	12'500	1'000	17'700 CHF	93.35%	16'522'950.00	0.46	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNVS 0 1/2 03/15/29	0	2'500	1'500	1'000 CHF	93.65%	936'500.00	0.03	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	0	2'500	0	2'500 CHF	98.22%	2'455'500.00	0.07	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.
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	2'400	1'500	0	3'900 CHF	91.75%	3'578'250.00	0.10	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	4'400	0	4'100	300 CHF	87.61%	262'830.00	0.01	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	4'000	0	0	4'000 CHF	94.00%	3'760'000.00	0.10	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	5'000	0	0	5'000 CHF	79.55%	3'977'500.00	0.11	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	3'370	0	0	3'370 CHF	85.45%	2'879'665.00	0.08	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	3'000	0	0	3'000 CHF	94.57%	2'837'100.00	0.08	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	400	10'100	0	10'500 CHF	99.05%	10'400'250.00	0.29	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	3'500	3'000	1'500	5'000 CHF	94.64%	4'732'000.00	0.13	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'000	7'000	5'000	8'000 CHF	95.50%	7'640'000.00	0.21	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNWX 0 3/4 10/12/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	12'000	0	9'000	3'000 CHF	85.95%	2'578'500.00	0.07	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	5'000	10'000	5'000	10'000 CHF	88.65%	8'865'000.00	0.25	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	0	22'750	7'000	15'750 CHF	82.90%	13'056'750.00	0.36	a)
CH0440081401XXX	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 * RETIRED*	12'750	0	12'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	57'500	0	57'500 CHF	104.86%	60'294'500.00	1.68	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	3'000	0	0	3'000 CHF	88.85%	2'665'500.00	0.07	a)
CH0457206800	0.3000 % ABBNWX 0.3 08/06/24	1'000	200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	5'000	1'000	0	6'000 CHF	99.23%	5'953'620.00	0.17	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	12'500	0	12'500	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	80.90%	1'618'000.00	0.04	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	4'420	800	0	5'220 CHF	97.25%	5'076'450.00	0.14	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	8'000	11'500	0	19'500 CHF	88.40%	17'238'000.00	0.48	a)
CH0463112083	0.2500 % SLHNVX 0 1/4 10/11/23	3'210	605	3'815	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.75%	927'500.00	0.03	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'000	0	0	6'000 CHF	92.25%	5'535'000.00	0.15	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	1'500	0	0	1'500 CHF	89.64%	1'344'600.00	0.04	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	7'000	1'000	5'000	3'000 CHF	94.62%	2'838'600.00	0.08	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	14'200	0	3'000	11'200 CHF	85.20%	9'542'400.00	0.27	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	0	5'000	0	5'000 CHF	77.40%	3'870'000.00	0.11	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	4'000	12'500	4'500	12'000 CHF	62.55%	7'506'000.00	0.21	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	5'000	0	0	5'000 CHF	81.10%	4'055'000.00	0.11	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'000	0	0	1'000 CHF	56.25%	562'500.00	0.02	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	0	1'000	0	1'000 CHF	89.65%	896'500.00	0.02	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	6'500	0	3'000	3'500 CHF	96.37%	3'372'950.00	0.09	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	4'595	0	0	4'595 CHF	93.80%	4'310'110.00	0.12	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	13'500	7'300	0	20'800 CHF	88.60%	18'428'800.00	0.51	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	2'000	4'500	5'000	1'500 CHF	92.05%	1'380'750.00	0.04	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	500	0	0	500 CHF	89.55%	447'750.00	0.01	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'250	0	0	1'250 CHF	92.85%	1'160'625.00	0.03	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	400	5'000	0	5'400 CHF	80.70%	4'357'800.00	0.12	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	10'000	0	0	10'000 CHF	84.15%	8'415'000.00	0.23	a)
CH0520663581	0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.60%	2'898'000.00	0.08	a)
CH0520663599	0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	86.25%	862'500.00	0.02	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	15'000	0	0	15'000 CHF	88.80%	13'320'000.00	0.37	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	0	0	8'000 CHF	95.70%	7'656'000.00	0.21	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	0	7'750	7'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	7'500	10'000	0	17'500 CHF	97.65%	17'088'750.00	0.48	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	3'400	5'000	4'400	4'000 CHF	93.42%	3'736'800.00	0.10	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	1'300	17'000	0	18'300 CHF	66.85%	12'233'550.00	0.34	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	1'000	1'000	0	2'000 CHF	99.97%	1'999'400.00	0.06	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.
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	0	6'000	0	6'000 CHF	73.87%	4'432'200.00	0.12	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	0	3'000	0	3'000 CHF	71.90%	2'157'000.00	0.06	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	2'700	4'000	1'000	5'700 CHF	90.31%	5'147'670.00	0.14	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	5'000	0	2'600	2'400 CHF	82.90%	1'989'600.00	0.06	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	8'600	17'150	13'750	12'000 CHF	93.04%	11'164'800.00	0.31	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	1'200	4'000	5'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	4'900	0	0	4'900 CHF	79.45%	3'893'050.00	0.11	a)
CH0536893602	1.0000 % STMNSW 1 10/03/23	11'250	1'750	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032877	1.0000 % LONNVX 1 04/28/23	8'240	8'000	16'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	1'000	0	0	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.03	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	8'000	0	5'000	3'000 CHF	97.50%	2'925'000.00	0.08	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	5'000	0	0	5'000 CHF	91.95%	4'597'500.00	0.13	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	5'500	0	0	5'500 CHF	97.70%	5'373'500.00	0.15	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	94.55%	4'727'500.00	0.13	a)
CH0550413360	0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	92.15%	3'686'000.00	0.10	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	0	500	0	500 CHF	74.15%	370'750.00	0.01	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	0	3'800	0	3'800 CHF	74.20%	2'819'600.00	0.08	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'600	0	0	1'600 CHF	97.65%	1'562'400.00	0.04	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	0	5'000	0	5'000 CHF	97.35%	4'867'500.00	0.14	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	4'200	2'400	6'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	24'000	0	0	24'000 CHF	90.40%	21'696'000.00	0.60	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	5'000	7'000	5'000	7'000 CHF	90.04%	6'302'800.00	0.18	a)
CH0557778625	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 NOV	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778633	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37 NOV	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778658	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 DEC	0	30'000	30'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778666	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 0001	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778690	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 JAN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	0	3'000	1'500	1'500 CHF	75.30%	1'129'500.00	0.03	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	320	0	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	3'750	2'750	0	6'500 CHF	87.05%	5'658'250.00	0.16	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	3'000	0	0	3'000 CHF	85.60%	2'568'000.00	0.07	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	20'250	1'000	0	21'250 CHF	90.12%	19'150'500.00	0.53	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	4'000	0	0	4'000 CHF	70.50%	2'820'000.00	0.08	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	3'800	2'000	0	5'800 CHF	85.04%	4'932'320.00	0.14	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	13'300	1'500	0	14'800 CHF	90.85%	13'445'800.00	0.37	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	200	0	0	200 CHF	90.15%	180'300.00	0.01	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	5'000	2'000	0	7'000 CHF	84.45%	5'911'500.00	0.16	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	17'750	0	3'000	14'750 CHF	92.01%	13'571'475.00	0.38	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	5'000	3'000	0	8'000 CHF	84.95%	6'796'000.00	0.19	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	11'700	0	0	11'700 CHF	79.71%	9'326'070.00	0.26	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	82.70%	4'135'000.00	0.11	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	0	3'000	0	3'000 CHF	72.45%	2'173'500.00	0.06	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	2'200	3'500	1'500	4'200 CHF	84.85%	3'563'700.00	0.10	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	5'000	0	0	5'000 CHF	89.25%	4'462'500.00	0.12	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	17'000	2'400	10'000	9'400 CHF	89.19%	8'383'860.00	0.23	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	5'000	0	0	5'000 CHF	88.45%	4'422'500.00	0.12	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	11'100	1'000	2'100	10'000 CHF	93.40%	9'340'000.00	0.26	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	4'200	0	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	11'000	2'500	11'000	2'500 CHF	85.90%	2'147'500.00	0.06	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	3'000	4'500	0	7'500 CHF	88.15%	6'611'250.00	0.18	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	4'000	0	0	4'000 CHF	90.05%	3'602'000.00	0.10	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	11'000	2'100	0	13'100 CHF	88.62%	11'609'220.00	0.32	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	4'500	0	0	4'500 CHF	82.90%	3'730'500.00	0.10	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'875	0	0	1'875 CHF	95.25%	1'785'937.50	0.05	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	85.70%	3'428'000.00	0.10	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	9'000	0	9'000	0 CHF	0.00%	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.
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	11'000	4'000	0	15'000 CHF	87.05%	13'057'500.00	0.36 a)	
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	3'400	0	0	3'400 CHF	85.85%	2'918'900.00	0.08 a)	
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	4'000	0	3'000	1'000 CHF	86.35%	863'500.00	0.02 a)	
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	4'400	5'000	0	9'400 CHF	91.75%	8'624'500.00	0.24 a)	
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	1'300	1'000	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'000	1'000	0	3'000 CHF	74.55%	2'236'500.00	0.06 a)	
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	0	5'000	0	5'000 CHF	80.70%	4'035'000.00	0.11 a)	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500	0	0	1'500 CHF	88.70%	1'330'500.00	0.04 a)	
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	2'200	2'100	1'000	3'300 CHF	87.69%	2'893'770.00	0.08 a)	
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'200	1'000	0	3'200 CHF	79.20%	2'534'400.00	0.07 a)	
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	4'270	0	0	4'270 CHF	96.20%	4'107'740.00	0.11 a)	
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	0	3'500	0	3'500 CHF	86.00%	3'010'000.00	0.08 a)	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	10'000	10'000	0	20'000 CHF	87.75%	17'550'000.00	0.49 a)	
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	0	1'000	0	1'000 CHF	82.45%	824'500.00	0.02 a)	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	5'000	6'000	0	11'000 CHF	86.15%	9'476'500.00	0.26 a)	
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	4'600	1'500	5'400	700 CHF	88.48%	619'360.00	0.02 a)	
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	3'400	6'000	0	9'400 CHF	82.12%	7'719'280.00	0.21 a)	
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	2'800	0	0	2'800 CHF	89.15%	2'496'200.00	0.07 a)	
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'650	7'500	0	9'150 CHF	96.40%	8'820'600.00	0.25 a)	
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	5'000	5'000	0	10'000 CHF	82.45%	8'245'000.00	0.23 a)	
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	8'000	0	0	8'000 CHF	90.85%	7'268'000.00	0.20 a)	
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	26'500	0	0	26'500 CHF	88.70%	23'505'500.00	0.65 a)	
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	6'400	0	0	6'400 CHF	91.05%	5'827'200.00	0.16 a)	
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	17'500	0	0	17'500 CHF	88.79%	15'538'250.00	0.43 a)	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	10'000	0	0	10'000 CHF	88.55%	8'855'000.00	0.25 a)	
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	5'600	0	0	5'600 CHF	95.69%	5'358'640.00	0.15 a)	
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	9'750	0	9'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	0	2'000	0	2'000 CHF	96.06%	1'921'200.00	0.05 a)	
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	0	2'000	0	2'000 CHF	89.40%	1'788'000.00	0.05 a)	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	5'000	0	0	5'000 CHF	96.50%	4'825'000.00	0.13 a)	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	0	5'000	0	5'000 CHF	88.40%	4'420'000.00	0.12 a)	
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'000	0	0	6'000 CHF	71.65%	4'299'000.00	0.12 a)	
CH1167887285	0.0000 % ABBNVX 0 09/25/23	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	10'000	0	0	10'000 CHF	94.15%	9'415'000.00	0.26 a)	
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	7'500	0	3'000	4'500 CHF	94.18%	4'238'100.00	0.12 a)	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	14'500	0	0	14'500 CHF	92.54%	13'418'300.00	0.37 a)	
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	5'000	0	1'300	3'700 CHF	89.50%	3'311'500.00	0.09 a)	
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	7'600	1'600	7'000	2'200 CHF	93.60%	2'059'200.00	0.06 a)	
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	12'000	0	0	12'000 CHF	98.04%	11'764'800.00	0.33 a)	
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	5'000	0	0	5'000 CHF	97.35%	4'867'500.00	0.14 a)	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	6'000	0	1'500	4'500 CHF	95.74%	4'308'300.00	0.12 a)	
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	23'000	0	0	23'000 CHF	84.46%	19'425'800.00	0.54 a)	
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	3'000	0	0	3'000 CHF	94.10%	2'823'000.00	0.08 a)	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	1'400	0	0	1'400 CHF	98.00%	1'372'000.00	0.04 a)	
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	7'500	8'750	0	16'250 CHF	97.45%	15'835'625.00	0.44 a)	
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	0	11'000	7'700	3'300 CHF	97.52%	3'218'160.00	0.09 a)	
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	12'500	1'750	0	14'250 CHF	97.50%	13'893'750.00	0.39 a)	
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	9'000	11'000	1'000	19'000 CHF	99.28%	18'863'200.00	0.52 a)	
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	15'000	0	0	15'000 CHF	99.73%	14'959'500.00	0.42 a)	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	15'000	700	0	15'700 CHF	100.77%	15'820'890.00	0.44 a)	
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	18'800	0	0	18'800 CHF	98.82%	18'578'160.00	0.52 a)	
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	5'900	0	1'500	4'400 CHF	99.20%	4'364'800.00	0.12 a)	
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	6'000	4'500	0	10'500 CHF	100.10%	10'510'500.00	0.29 a)	
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	4'250	4'250	0	8'500 CHF	98.50%	8'372'500.00	0.23 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.
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	14'000	0	4'000	10'000 CHF	97.70%	9'770'000.00	0.27	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	0	0	2'500 CHF	97.70%	2'442'500.00	0.07	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	2'900	750	3'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	8'000	0	0	8'000 CHF	100.80%	8'064'000.00	0.22	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	6'000	0	0	6'000 CHF	100.35%	6'021'000.00	0.17	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	0	19'500	19'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	7'600	7'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	100.60%	5'030'000.00	0.14	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	6'000	0	0	6'000 CHF	103.35%	6'201'000.00	0.17	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	15'000	0	2'000	13'000 CHF	106.47%	13'841'100.00	0.38	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	0	12'000	0	12'000 CHF	109.67%	13'160'400.00	0.37	a)
CH1194355082	1.8750 % CS 1 7/8 06/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	100.05%	10'005'000.00	0.28	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	105.65%	2'641'250.00	0.07	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	3'950	0	0	3'950 CHF	104.55%	4'129'725.00	0.11	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	0	3'300	0	3'300 CHF	100.30%	3'309'900.00	0.09	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	0	10'000 CHF	99.47%	9'947'000.00	0.28	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	0	21'000	0	21'000 CHF	103.05%	21'640'500.00	0.60	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	0	4'000	0	4'000 CHF	106.85%	4'274'000.00	0.12	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	0	14'500	1'500	13'000 CHF	107.60%	13'988'000.00	0.39	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	0	10'600	1'000	9'600 CHF	101.25%	9'720'000.00	0.27	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	0	21'000	0	21'000 CHF	100.45%	21'094'500.00	0.59	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	9'000	0	9'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	5'000	0	0	5'000 CHF	99.75%	4'987'500.00	0.14	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	5'500	0	0	5'500 CHF	100.15%	5'508'250.00	0.15	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	0	7'000	1'000	6'000 CHF	102.15%	6'129'000.00	0.17	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	7'500	0	2'000	5'500 CHF	100.55%	5'530'250.00	0.15	a)
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	8'000	5'000	3'000 CHF	100.15%	3'004'500.00	0.08	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	108.15%	5'407'500.00	0.15	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	6'500	0	6'500 CHF	101.20%	6'578'000.00	0.18	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	0	2'000	0	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.06	a)
CH1218301948	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 06/25/24 729	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	2'000	0	1'000	1'000 CHF	103.30%	1'033'000.00	0.03	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	0	17'000	2'500	14'500 CHF	105.55%	15'304'750.00	0.43	a)
CH1218302011	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 NOV	0	45'000	45'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759511	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 DEC	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759529	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 DEC	0	12'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	0	17'500	10'000	7'500 CHF	102.50%	7'687'500.00	0.21	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	0	11'000	11'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	0	13'500	9'000	4'500 CHF	99.88%	4'494'600.00	0.12	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	0	10'000	0	10'000 CHF	100.21%	10'021'000.00	0.28	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	0	10'000	1'000	9'000 CHF	99.99%	8'999'100.00	0.25	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	0	5'000	0	5'000 CHF	98.85%	4'942'500.00	0.14	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	0	10'000	0	10'000 CHF	100.45%	10'045'000.00	0.28	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	0	10'000	0	10'000 CHF	101.20%	10'120'000.00	0.28	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464535	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 FEB	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	0	10'000	500	9'500 CHF	105.15%	9'989'250.00	0.28	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	0	8'000	0	8'000 CHF	103.60%	8'288'000.00	0.23	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	8'000	0	8'000 CHF	110.20%	8'816'000.00	0.25	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	1'750	0	1'750 CHF	103.30%	1'807'750.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	10'000	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.28	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	6'500	1'800	4'700 CHF	102.20%	4'803'400.00	0.13	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	9'200	3'750	5'450 CHF	103.10%	5'618'950.00	0.16	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	14'200	0	14'200 CHF	102.00%	14'484'000.00	0.40	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	0	10'000	0	10'000 CHF	101.15%	10'115'000.00	0.28	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	0	5'000	1'000	4'000 CHF	101.30%	4'052'000.00	0.11	a)
CH1239495000	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 JAN	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	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.
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	0	4'000	0	4'000 CHF	102.00%	4'080'000.00	0.11	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	0	3'500	0	3'500 CHF	104.10%	3'643'500.00	0.10	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	0	40'000	2'500	37'500 CHF	101.36%	38'010'000.00	1.06	a)
CH1243651960	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 FEB	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	5'325	5'325	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249415998	2.4586 % CS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	10'495	0	10'495 CHF	100.39%	10'535'930.50	0.29	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26	0	7'000	5'000	2'000 CHF	101.53%	2'030'600.00	0.06	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	31'700	0	31'700 CHF	103.10%	32'682'700.00	0.91	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	10'000	0	10'000 CHF	100.70%	10'070'000.00	0.28	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	5'140	0	5'140 CHF	100.40%	5'160'560.00	0.14	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	0	10'000	0	10'000 CHF	99.98%	9'998'000.00	0.28	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	5'000	0	5'000 CHF	101.25%	5'062'500.00	0.14	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	0	3'000	0	3'000 CHF	102.20%	3'066'000.00	0.09	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	30'500	0	30'500 CHF	102.65%	31'308'250.00	0.87	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	3'000	1'000	2'000 CHF	101.10%	2'022'000.00	0.06	a)
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887378	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	4'650	0	4'650 CHF	118.45%	5'507'925.00	0.15	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	0	10'000	0	10'000 CHF	100.20%	10'020'000.00	0.28	a)
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	10'000	0	10'000 CHF	101.20%	10'120'000.00	0.28	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	29'250	2'000	27'250 CHF	101.17%	27'568'825.00	0.77	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	1'000	0	1'000 CHF	100.82%	1'008'200.00	0.03	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	3'300	0	3'300 CHF	101.25%	3'341'250.00	0.09	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	8'750	8'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	9'450	0	9'450 CHF	102.60%	9'695'700.00	0.27	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	4'000	0	4'000 CHF	100.91%	4'036'400.00	0.11	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	11'000	1'300	9'700 CHF	98.71%	9'574'870.00	0.27	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	11'250	0	11'250 CHF	101.10%	11'373'750.00	0.32	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	22'500	0	22'500 CHF	100.09%	22'520'250.00	0.63	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	0	11'000	11'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	5'000	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.14	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	0	5'000	0	5'000 CHF	102.75%	5'137'500.00	0.14	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	6'000	0	6'000 CHF	102.82%	6'169'440.00	0.17	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.14	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	6'800	0	6'800 CHF	100.55%	6'837'128.68	0.19	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	3'850	0	3'850 CHF	101.25%	3'898'163.50	0.11	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	10'000	0	10'000 CHF	100.55%	10'055'000.00	0.28	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	0	5'000	0	5'000 CHF	100.65%	5'032'500.00	0.14	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.05%	5'052'500.00	0.14	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	5'000	0	5'000 CHF	101.35%	5'067'500.00	0.14	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	2'700	0	2'700 CHF	102.40%	2'764'800.00	0.08	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	5'000	0	5'000 CHF	100.50%	5'025'000.00	0.14	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	5'000	0	5'000 CHF	100.85%	5'042'500.00	0.14	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	0	10'000	0	10'000 CHF	100.88%	10'088'300.00	0.28	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43	0	16'000	0	16'000 CHF	99.79%	15'965'600.00	0.44	a)
CH							2'475'798'582.68	68.83	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.72%	997'200.00	0.03	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	98.25%	2'947'500.00	0.08	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	500	700	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	95.30%	3'812'000.00	0.11	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	5'000	4'000	0	9'000 CHF	93.40%	8'406'000.00	0.23	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	91.95%	2'758'500.00	0.08	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	4'000	3'200	0	7'200 CHF	93.00%	6'696'000.00	0.19	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	93.45%	9'345'000.00	0.26	a)
CL							34'962'200.00	0.97	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	4'000	3'000	0	7'000 CHF	99.72%	6'980'400.00	0.19	a)
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	92.30%	2'307'500.00	0.06	a)
CH0399198396	0.6250 % DB 0 5/8 02/08/23 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	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.
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	940	1'000	1'940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	520	0	0	520 CHF	92.05%	478'660.00	0.01	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	87.75%	877'500.00	0.02	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	97.44%	2'533'440.00	0.07	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	7'000	0	4'000	3'000 CHF	86.60%	2'598'000.00	0.07	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	90.70%	4'535'000.00	0.13	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 CHF	90.50%	3'620'000.00	0.10	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	81.00%	2'430'000.00	0.07	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	2'200	8'200	6'800	3'600 CHF	93.20%	3'355'200.00	0.09	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	85.75%	3'001'250.00	0.08	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	7'800	0	0	7'800 CHF	92.60%	7'222'800.00	0.20	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	89.20%	7'136'000.00	0.20	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	89.45%	6'261'500.00	0.17	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	95.90%	7'288'400.00	0.20	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.30%	5'115'000.00	0.14	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	4'000	5'000	0	9'000 CHF	106.65%	9'598'500.00	0.27	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.14	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	10'500	0	10'500 CHF	100.30%	10'531'500.00	0.29	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.35%	10'135'000.00	0.28	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	101.90%	8'152'000.00	0.23	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.05%	4'042'000.00	0.11	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	101.30%	3'545'500.00	0.10	a)
DE							116'792'650.00	3.25	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.45%	10'145'000.00	0.28	a)
DK							10'145'000.00	0.28	
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	8'300	4'000	8'300	4'000 CHF	100.80%	4'032'000.00	0.11	a)
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	5'650	0	5'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	2'600	1'000	0	3'600 CHF	98.80%	3'556'800.00	0.10	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	3'000	3'000	4'600	1'400 CHF	94.60%	1'324'400.00	0.04	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	4'300	2'000	0	6'300 CHF	91.80%	5'783'400.00	0.16	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	93.45%	2'429'700.00	0.07	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	12'000	0	12'000 CHF	100.50%	12'060'000.00	0.34	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	10'500	0	10'500 CHF	100.90%	10'594'500.00	0.29	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	7'500	0	7'500 CHF	102.80%	7'710'000.00	0.21	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	3'200	0	3'200 CHF	103.00%	3'296'000.00	0.09	a)
ES							50'786'800.00	1.41	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	0	700	0	700 CHF	99.06%	693'413.00	0.02	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	95.65%	1'147'800.00	0.03	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.28	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	11'000	0	11'000 CHF	101.15%	11'126'500.00	0.31	a)
FI							23'107'713.00	0.64	
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	9'500	500	0	10'000 CHF	101.21%	10'121'000.00	0.28	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	4'320	0	0	4'320 CHF	102.05%	4'408'560.00	0.12	a)
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	5'750	0	5'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	0	5'000	3'000	2'000 CHF	98.03%	1'960'600.00	0.05	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	0	4'600	0	4'600 CHF	99.50%	4'577'000.00	0.13	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	91.50%	4'575'000.00	0.13	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.
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'000	3'000	2'400	2'600 CHF	93.25%	2'424'500.00	0.07	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	90.50%	4'525'000.00	0.13	a)
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	91.30%	1'278'200.00	0.04	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	3'400	600	2'000	2'000 CHF	93.10%	1'862'000.00	0.05	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	11'000	2'000	0	13'000 CHF	92.95%	12'083'500.00	0.34	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	102.30%	3'478'200.00	0.10	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	2'600	5'200	0	7'800 CHF	91.30%	7'121'400.00	0.20	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	101.40%	1'216'800.00	0.03	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.50%	5'125'000.00	0.14	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	5'000	3'000	2'000 CHF	100.30%	2'006'000.00	0.06	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.05%	3'031'500.00	0.08	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	100.85%	2'521'250.00	0.07	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.95%	10'195'000.00	0.28	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.10%	5'105'000.00	0.14	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	102.70%	8'216'000.00	0.23	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	10'750	0	10'750 CHF	100.95%	10'852'125.00	0.30	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.30%	10'130'000.00	0.28	a)
FR							116'813'635.00	3.25	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.19%	1'963'800.00	0.05	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	0	500	0	500 CHF	88.30%	441'500.00	0.01	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	93.50%	7'106'000.00	0.20	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	14'000	0	0	14'000 CHF	92.65%	12'971'000.00	0.36	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	1'000	8'400	3'000	6'400 CHF	85.20%	5'452'800.00	0.15	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	6'400	0	0	6'400 CHF	91.05%	5'827'200.00	0.16	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	4'800	0	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	0	5'000	0	5'000 CHF	100.15%	5'007'500.00	0.14	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	0	500	0	500 CHF	101.65%	508'250.00	0.01	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	0	8'600	8'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	12'000	0	12'000 CHF	101.45%	12'174'000.00	0.34	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.00%	5'050'000.00	0.14	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.15%	5'057'500.00	0.14	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.80%	5'090'000.00	0.14	a)
GB							66'649'550.00	1.85	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	2'400	7'600	0	10'000 CHF	98.05%	9'805'000.00	0.27	a)
IE							9'805'000.00	0.27	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	4'000	10'000	0	14'000 CHF	97.92%	13'708'800.00	0.38	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	97.90%	2'447'500.00	0.07	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	0	500	0	500 CHF	87.45%	437'250.00	0.01	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	5'000	7'000	0	12'000 CHF	97.15%	11'658'000.00	0.32	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	5'000	5'000	0	10'000 CHF	100.60%	10'060'000.00	0.28	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	0	10'000	0	10'000 CHF	100.10%	10'010'000.00	0.28	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	4'545	0	4'545 CHF	100.65%	4'574'542.50	0.13	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	10'000	0	10'000 CHF	100.95%	10'095'000.00	0.28	a)
KR							62'991'092.50	1.75	
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	0	500	0	500 CHF	97.86%	489'300.00	0.01	a)
KY							489'300.00	0.01	
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	0	5'500	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	2'000	1'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LI							0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	8'000	2'000	2'000	8'000 CHF	99.84%	7'987'200.00	0.22	a)
LU							7'987'200.00	0.22	

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.
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.03	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	0	3'000	0	3'000 CHF	103.60%	3'108'000.00	0.09	a)
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23 EMTN	5'500	4'000	9'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	400	0	0	400 CHF	99.77%	399'080.00	0.01	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'500	2'000	0	3'500 CHF	99.73%	3'490'550.00	0.10	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.03	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	0	4'480	0	4'480 CHF	74.40%	3'333'120.00	0.09	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	2'500	0	0	2'500 CHF	93.20%	2'330'000.00	0.06	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	2'500	0	1'500	1'000 CHF	87.40%	874'000.00	0.02	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	1'500	0	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.04	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	96.95%	3'102'400.00	0.09	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	100.85%	10'085'000.00	0.28	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.65%	10'165'000.00	0.28	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	0	10'000	0	10'000 CHF	101.85%	10'185'000.00	0.28	a)
NL							50'509'650.00	1.40	
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	0	4'125	4'125	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	0	4'300	0	4'300 CHF	99.29%	4'269'470.00	0.12	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	2'400	1'600	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	2'650	0	2'650 CHF	97.35%	2'579'775.00	0.07	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	98.25%	3'930'000.00	0.11	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.55%	4'977'500.00	0.14	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	100.90%	2'219'800.00	0.06	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.15%	10'215'000.00	0.28	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.10%	5'055'000.00	0.14	a)
NO							33'246'545.00	0.92	
CH0204017005	1.1250 % AUCCKN 1 1/8 02/07/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	4'000	7'500	11'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451825	0.2500 % ANZSZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357520433	0.2500 % ANZSZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	7'000	1'000	0	8'000 CHF	96.95%	7'756'000.00	0.22	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZSZ 0.35 10/22/24 EMTN	2'000	1'750	0	3'750 CHF	98.33%	3'687'375.00	0.10	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	98.17%	490'850.00	0.01	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	5'500	0	3'750	1'750 CHF	91.15%	1'595'125.00	0.04	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400080	1.6600 % AUCCKN 1.66 10/18/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	100.40%	5'020'000.00	0.14	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCKN 2.005 10/18/32 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.15%	5'107'500.00	0.14	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	3'750	0	3'750 CHF	101.85%	3'819'375.00	0.11	a)
NZ							27'476'225.00	0.76	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	0	500	0	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.01	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.03	a)
CH0302790115	0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	4'910	1'000	0	5'910 CHF	92.55%	5'469'705.00	0.15	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	550	0	0	550 CHF	96.10%	528'550.00	0.01	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	96.55%	3'862'000.00	0.11	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	99.70%	9'970'000.00	0.28	a)
SE							21'292'755.00	0.59	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	0	10'000	0	10'000 CHF	99.70%	9'970'000.00	0.28	a)
SG							9'970'000.00	0.28	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	13'300	0	13'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.11%	4'955'500.00	0.14	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.
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	750	1'500	0	2'250 CHF	98.43%	2'214'675.00	0.06	a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	10'500	6'000	16'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	8'000	0	3'000	5'000 CHF	96.90%	4'845'000.00	0.13	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	6'410	7'500	0	13'910 CHF	95.50%	13'284'050.00	0.37	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	5'000	0	3'500	1'500 CHF	93.45%	1'401'750.00	0.04	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	5'000	3'000	0	8'000 CHF	92.05%	7'364'000.00	0.20	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'500	3'000	0	4'500 CHF	90.80%	4'086'000.00	0.11	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	89.00%	2'670'000.00	0.07	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	90.00%	6'750'000.00	0.19	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.45%	502'250.00	0.01	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	4'900	1'900	3'000 CHF	101.85%	3'055'500.00	0.08	a)
US							51'128'725.00	1.42	
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	0	4'000	0	4'000 CHF	107.80%	4'312'000.00	0.12	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	6'450	0	0	6'450 CHF	103.65%	6'685'425.00	0.19	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	0	4'000	0	4'000 CHF	102.05%	4'082'000.00	0.11	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	3'000	3'000	0	3'000 CHF	95.95%	2'878'500.00	0.08	a)
CH0292086193	0.4500 % CAF 0.45 09/07/23 EMTN	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	97.20%	1'458'000.00	0.04	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'500	3'350	0	4'850 CHF	96.45%	4'677'825.00	0.13	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	0	4'000	0	4'000 CHF	99.13%	3'965'200.00	0.11	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	7'000	0	0	7'000 CHF	93.50%	6'545'000.00	0.18	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	3'000	2'000	0	5'000 CHF	97.30%	4'865'000.00	0.14	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	10'000	0	1'750	8'250 CHF	84.15%	6'942'375.00	0.19	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.05%	1'801'000.00	0.05	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	87.70%	6'139'000.00	0.17	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	94.25%	2'827'500.00	0.08	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	98.15%	9'815'000.00	0.27	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.30%	4'965'000.00	0.14	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	0	9'650	0	9'650 CHF	100.25%	9'674'125.00	0.27	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.25%	5'062'500.00	0.14	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.85%	5'092'500.00	0.14	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	0	5'000	0	5'000 CHF	99.45%	4'972'500.00	0.14	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.45%	10'145'000.00	0.28	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	0	15'000	0	15'000 CHF	101.00%	15'150'000.00	0.42	a)
XS							122'055'450.00	3.39	
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	
CH0215804664	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB CHF NT CHF	0	506'231	506'231	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							-891'101.55	-0.02	
Swaps							-891'101.55	-0.02	
02/29	IRS FIX LEG -0.2575% P.A. CHF	-15'000	15'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
02/29	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
01/31	IRS FIX LEG 0.1% P.A. CHF	-20'000	20'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/31	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	20'000	0	20'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	0	0	15'000	-15'000 CHF	102.46%	-15'369'128.25	-0.43	b)
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	0.42	b)
09/32	IRS FIX LEG 01.8325% P.A. CHF	-25'000	25'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
09/32	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	25'000	0	25'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
02/33	IRS FIX LEG 1.8225% P.A. CHF	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	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.
02/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	0	0	30'000	-30'000 CHF	101.74%	-30'521'973.30	-0.85	b)
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	30'000	0	30'000 CHF	100.00	30'000'000.00	0.83	b)
03/42	IRS FIX LEG 0.9375% P.A. CHF	-7'500	7'500	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
03/42	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/45	IRS FIX LEG 1.3825% P.A. CHF	-10'000	10'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
06/45	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
01/49	IRS FIX LEG 1.465% P.A. CHF	-5'000	5'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/49	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/52	IRS FIX LEG 0.7025% P.A. CHF	-5'000	5'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
03/52	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	59'751'597.78	1.66
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'513'839'028.18	97.68
Derivative Finanzinstrumente	-891'101.55	-0.02
Sonstige Vermögenswerte	24'499'529.17	0.68
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'597'199'053.58	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-798'803.86	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'596'400'249.72	

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);	3'513'839'028.18	97.68
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-891'101.55	-0.02
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts	Währung	Betrag
OTC COLLATERAL IV-BFNCHF CHF ZKB	600'000 CHF	600'000.00

OTC Gegenparteien
Zürcher Kantonalbank

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	45'891'101.55	1.276

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
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT 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
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.

8 Benchmark

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

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 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.15000	0.05250	0.09750
BA CHF	Nein	CHF	0.50000	0.17500	0.32500

11 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
CT CHF	Nein	CHF	0.50817	0.17785	0.33032
DT CHF	Nein	CHF	0.61755	0.21614	0.40141
GT CHF	Nein	CHF	0.61179	0.21412	0.39767
NT CHF	Nein	CHF	12.048	4.216	7.832

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: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

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 Prüfungsgesellschaft 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