

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL RATES

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	41253666	CHF
CT CHF	41253667	CHF
GT CHF	41253668	CHF
NT CHF	3009873	CHF
NT USD	125531425	USD
NTH1 CHF	49241069	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 23. Februar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Fund I,

mit den Teilvermögen

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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	22
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	22
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
8	Pauschale Verwaltungskommission	24
9	Benchmark	24
10	TER	24
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
13	Fussnoten	25
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26
15	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		499'908'675.74	360'139'579.40	425'116'466.88	418'489'043.59
Klasse AA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		32'362'439.83	41'161'222.89	56'869'758.33	70'491'486.96
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		429'090.159	493'320.812	573'164.927	688'764.886
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		75.4211	83.4370	99.2206	102.3448
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		75.4512	83.4370	99.2702	102.2629
Ausschüttung je Anteil		0.10	0.15	0.80	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
Klasse CT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		15'968'691.77	20'067'069.68	27'588'771.13	31'122'035.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		202'061.142	230'600.732	268'867.916	296'336.247
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.0290	87.0208	102.6109	105.0227
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		79.0606	87.0208	102.6622	104.9387
Thesaurierung je Anteil		0.45	0.43	1.27	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode				-	267'365.50
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				-	2'542.285
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				-	105.1674
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP				-	105.0833
Thesaurierung je Anteil				-	1.52
Total Expense Ratio (TER)				-	0.38 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		177'376'234.98	120'578'093.61	208'682'159.32	210'213'862.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		155'832.278	96'489.200	142'066.990	140'266.990
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'138.2509	1'249.6538	1'468.8997	1'498.6695
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'138.7062	1'249.6538	1'469.6342	1'497.4706
Thesaurierung je Anteil		12.50	12.90	25.58	27.38
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		12'974'305.02			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		154'239.560			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.4322			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.4691			
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		0.70			
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %			

Klasse NTH1 CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	261'227'004.14	178'333'193.22	131'975'778.10	106'394'293.50
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	3'175'843.948	2'080'435.249	1'341'135.464	1'040'945.973
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	82.2544	85.7192	98.4060	102.2092
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	82.2873	85.7192	98.4552	102.1275
Thesaurierung je Anteil	0.89	0.86	1.71	1.83
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	-9.40 %	-16.47 %	-2.69 %	0.97 %
Klasse CT CHF	-8.99 %	-16.09 %	-2.25 %	1.44 %
Klasse GT CHF (Schliessung 03.09.2021)	-	-	1.11 %	1.55 %
Klasse NT CHF	-8.58 %	-15.74 %	-1.76 %	1.93 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	-7.63 %	-	-	-
Klasse NTH1 CHF	-3.70 %	-12.77 %	-3.07 %	5.29 %
Benchmark Hedge	-3.40 %	-13.39 %	-	-
Benchmark	-8.65 %	-16.47 %	-2.44 %	1.68 %
Tracking Error 33)	0.35 %	0.65 %	0.53 %	0.34 %

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	-0.75 %
Klasse CT CHF	-0.34 %
Klasse NT CHF	0.07 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	1.02 %
Klasse NTH1 CHF	-0.30 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2023	31.10.2022
Bankguthaben auf Sicht	13'436'822.36	11'846'677.08
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	528'371'785.30	348'289'127.15
Derivative Finanzinstrumente	-1'972'510.85	-1'370'011.47
Sonstige Vermögenswerte	2'863'606.13	1'415'250.57
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	542'699'702.94	360'181'043.33
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-42'757'008.38	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-34'018.82	-41'463.93
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	499'908'675.74	360'139'579.40

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		493'320.812	573'164.927
Ausgegebene Anteile		3'219.711	2'999.390
Zurückgenommene Anteile		-67'450.364	-82'843.505
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		429'090.159	493'320.812

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		230'600.732	268'867.916
Ausgegebene Anteile		1'752.811	2'300.418
Zurückgenommene Anteile		-30'292.401	-40'567.602
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		202'061.142	230'600.732

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		96'489.200	142'066.990
Ausgegebene Anteile		83'991.805	24'781.193
Zurückgenommene Anteile		-24'648.727	-70'358.983
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		155'832.278	96'489.200

	von bis	<i>Lancierung</i> 27.03.2023 31.10.2023	
Klasse NT USD			
Ausgegebene Anteile		154'339.560	
Zurückgenommene Anteile		-100.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		154'239.560	

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'080'435.249	1'341'135.464
Ausgegebene Anteile		1'942'490.559	1'353'073.564
Zurückgenommene Anteile		-847'081.860	-613'773.779
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'175'843.948	2'080'435.249

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		360'139'579.40	425'116'466.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-71'592.40	-435'855.19
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'276'146.46	-1'685'584.84
Saldo aus dem Anteilverkehr		168'697'998.87	-15'635'808.01
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-27'581'163.67	-47'219'639.44
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		499'908'675.74	360'139'579.40

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		77'151.67	523.34
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-19'203.46	-23'678.84
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'486'578.42	3'016'911.75
Erträge aus Wertpapierleihe		77'174.24	43'963.20
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'264'191.02	1'050'887.62
Total Ertrag		5'885'891.89	4'088'607.07
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-487.63
Reglementarische Vergütungen		-442'597.71	-579'383.74
Sonstige Aufwendungen		-504.00	-360.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-424'936.08	-389'577.90
Total Aufwand		-868'037.79	-969'809.27
Nettoertrag / Verlust		5'017'854.10	3'118'797.80
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-16'803'003.48	-15'633'565.77
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		186'975.26	210'095.67
Realisierter Erfolg		-11'598'174.12	-12'304'672.30
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-15'982'989.55	-34'914'967.14
Gesamterfolg		-27'581'163.67	-47'219'639.44

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF			
	31.10.2023	31.10.2022	
Nettoertrag	27'603.34	-18'714.75	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	0.00	18'714.75	
Vortrag des Vorjahres	22'723.73	96'721.85	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	50'327.07	96'721.85	
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	42'909.02	73'998.12	
Vortrag auf neue Rechnung	7'418.05	22'723.73	
Total	50'327.07	96'721.85	
Klasse CT CHF			
	31.10.2023	31.10.2022	
Nettoertrag	92'840.05	99'160.35	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	92'840.05	99'160.35	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	32'494.02	34'706.12	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	60'346.03	64'454.23	
Total	92'840.05	99'160.35	
Klasse NT CHF			
	31.10.2023	31.10.2022	
Nettoertrag	1'948'247.13	1'245'120.58	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'948'247.13	1'245'120.58	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	681'886.50	435'792.20	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'266'360.63	809'328.38	
Total	1'948'247.13	1'245'120.58	
Klasse NT USD			
	31.10.2023		
Nettoertrag	109'003.88		
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	109'003.88		
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	38'151.36		
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	70'852.52		
Total	109'003.88		
Klasse NTH1 CHF			
	31.10.2023	31.10.2022	
Nettoertrag	2'840'159.70	1'793'231.62	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'840'159.70	1'793'231.62	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	994'055.90	627'631.07	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'846'103.80	1'165'600.55	
Total	2'840'159.70	1'793'231.62	

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							528'371'785.30	97.36	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							528'371'785.30	97.36	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	20'000	0	10'000	10'000 CNY	98.48%	1'220'626.35	0.22	a)
AE							1'220'626.35	0.22	
AT0000A33SH3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	4'000	0	4'000 AUD	71.30%	1'643'201.91	0.30	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	750	5'550	3'500	2'800 AUD	95.61%	1'542'496.30	0.28	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'500	0	400	1'100 AUD	48.61%	308'117.93	0.06	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 1/2 11/21/31 163	750	0	750	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	0	3'000	2'000	1'000 AUD	80.27%	462'491.22	0.09	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	0	3'000	1'500	1'500 AUD	92.77%	801'817.19	0.15	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	3'000	2'500	0	5'500 AUD	66.60%	2'110'677.24	0.39	a)
USQ97417FA49	1.5520 % WSTP 1.552 09/30/26 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	89.67%	1'632'138.27	0.30	a)
XS2673140633	3.7680 % CBAAU 3.768 08/31/27	0	4'000	0	4'000 EUR	100.21%	3'855'594.64	0.71	a)
AU							12'356'534.70	2.28	
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	1'000	4'500	1'000	4'500 EUR	54.84%	2'373'842.73	0.44	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE							2'373'842.73	0.44	
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	0	1'750	0	1'750 CAD	67.66%	776'169.70	0.14	a)
CA110709GL02	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/32	1'000	1'000	0	2'000 CAD	88.78%	1'163'936.18	0.21	a)
CA12593ZAA80	3.9500 % CPPIBC 3.95 06/02/32	0	4'000	0	4'000 CAD	93.93%	2'462'865.46	0.45	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	0	2'100	0	2'100 CAD	89.58%	1'233'156.60	0.23	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	2'000	2'000	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L856	0.2500 % CAN 0 1/4 05/01/23	1'900	250	2'150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N423	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/24	0	1'800	0	1'800 CAD	98.27%	1'159'542.35	0.21	a)
CA13509PHX48	1.1000 % CANHOU 1.1 12/15/26	3'000	0	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	1'750	3'000	0	4'750 CAD	84.31%	2'625'311.35	0.48	a)
US22411WAG15	3.1250 % CPPIBC 3 1/8 09/25/23 REGS	4'000	2'450	6'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22411WAR79	0.5000 % CPPIBC 0 1/2 09/16/24 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	95.58%	1'739'724.38	0.32	a)
US30216BKB70	4.3750 % EDC 4 3/8 06/29/26	0	4'000	0	4'000 USD	98.30%	3'578'493.84	0.66	a)
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AF80	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 REGS	0	5'000	2'500	2'500 USD	98.14%	2'232'875.93	0.41	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	5'500	0	0	5'500 USD	89.22%	4'465'756.41	0.82	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	95.62%	2'575'451.03	0.47	a)
XS2344384842	0.9000 % ONTTFT 0.9 05/20/41 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2411135150	0.9500 % ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 EUR	47.00%	904'249.58	0.17	a)
XS2448412879	0.5000 % EDC 0 1/2 02/25/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	91.44%	1'759'152.33	0.32	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	0	4'000	0	4'000 EUR	85.65%	3'295'445.48	0.61	a)
XS2592761527	4.3750 % CPPIBC 4 3/8 03/02/26 EMTN	1'000	1'000	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	100.93%	1'671'838.68	0.31	a)
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	0	7'000	0	7'000 EUR	98.90%	6'659'620.62	1.23	a)
CA							38'303'589.92	7.06	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	1'250	500	750 CHF	99.36%	745'200.00	0.14	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	0	2'250	1'500	750 CHF	99.51%	746'325.00	0.14	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	1'300	300	1'000 CHF	99.31%	993'100.00	0.18	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	1'500	1'250	2'250	500 CHF	86.55%	432'750.00	0.08	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	1'000	1'000	1'250	750 CHF	93.40%	700'500.00	0.13	a)
CH							3'617'875.00	0.67	
CND100002BR5	4.0800 % CGB 4.08 03/01/40 1003	15'000	5'000	10'000	10'000 CNY	116.15%	1'439'726.06	0.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND100008593	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	10'000	0	0	10'000 CNY	102.26%	1'267'547.59	0.23	a)
CND10000L4H0	3.9000 % CGB 3.9 12/21/24 1727	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100010G02	3.6900 % CGB 3.69 05/17/28 1811	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	5'500	0	5'500	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	20'000	0	0	20'000 CNY	104.12%	2'581'140.65	0.48	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	9'000	20'000	0	29'000 CNY	101.37%	3'643'817.88	0.67	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	10'000	0	0	10'000 CNY	116.03%	1'438'178.26	0.27	a)
CND100045MS9	3.7200 % CGB 3.72 04/12/51 INBK	25'000	5'000	0	30'000 CNY	111.33%	4'139'789.66	0.76	a)
CND100047752	3.0100 % CGB 3.01 05/13/28 INBK	10'000	10'000	0	20'000 CNY	102.21%	2'533'670.13	0.47	a)
CND10004R114	2.3700 % CGB 2.37 01/20/27 INBK	15'000	45'000	25'000	35'000 CNY	99.75%	4'327'487.75	0.80	a)
CND100054BH7	2.7500 % CGB 2 3/4 06/15/29 INBK	25'000	8'000	0	33'000 CNY	100.68%	4'118'247.21	0.76	a)
CND10005TZQ1	2.8000 % CGB 2.8 11/15/32 INBK	0	40'000	0	40'000 CNY	100.87%	5'001'244.94	0.92	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	0	65'000	0	65'000 CNY	100.88%	8'127'780.37	1.50	a)
CND100069PK9	3.1900 % CGB 3.19 04/15/53 INBK	0	15'000	0	15'000 CNY	103.72%	1'928'379.42	0.36	a)
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CN							40'547'009.92	7.47	
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	5'000	0	0	5'000 CZK	99.13%	193'977.53	0.04	a)
CZ0001004600	0.4500 % CZGB 0.45 10/25/23 97	10'000	0	10'000	0 CZK	0.00%	0.00	0.00	
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	0	27'500	0	27'500 CZK	79.12%	851'535.97	0.16	a)
CZ0001005870	1.2500 % CZGB 1 1/4 02/14/25 120	10'000	3'000	0	13'000 CZK	95.03%	483'492.70	0.09	a)
CZ0001006167	0.0000 % CZGB 0 12/12/24 135	0	10'000	0	10'000 CZK	94.55%	370'003.75	0.07	a)
CZ							1'899'009.95	0.35	
DE0001030567	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/26 I/L	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	500	2'750	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102317	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/23	6'100	12'000	18'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102325	2.0000 % DBR 2 08/15/23	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	750	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	0	15'750	15'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	0	7'000	4'000	3'000 EUR	80.15%	2'312'952.77	0.43	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQC36	0.1250 % HESSEN 0 1/8 01/25/24 1701	1'000	0	0	1'000 EUR	99.16%	953'836.91	0.18	a)
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	0	4'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A254RB5	0.0000 % NIESA 0 02/11/27 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	90.04%	2'598'241.00	0.48	a)
DE000A3MP5P6	0.0100 % LANDER 0.01 10/08/27 61	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	2'000	0	0	2'000 EUR	90.80%	1'746'762.71	0.32	a)
DE000A3MQYR7	3.0000 % BERGER 3 05/04/28 548	0	5'000	3'000	2'000 EUR	99.07%	1'905'942.34	0.35	a)
DE000NRW0ML8	0.0000 % NRW 0 10/12/35 15YR	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0NF8	2.0000 % NRW 2 06/15/32 EMTN	2'650	350	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0NP7	3.0000 % NRW 3 01/27/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193666125	0.8750 % DBHNGR 0 7/8 06/23/39 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193877177	0.3750 % NRWK 0 3/8 12/16/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	6'000	2'500	0	8'500 PLN	99.40%	1'824'580.07	0.34	a)
XS2476782631	2.1250 % NRW 2 1/8 06/13/25 EMTN	2'400	0	2'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2541394750	3.8750 % DBHNGR 3 7/8 10/13/42 EMTN	575	0	575	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE							11'342'315.80	2.09	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	2'000	0	0	2'000 DKK	115.83%	298'565.63	0.06	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	2'000	4'500	0	6'500 DKK	87.13%	729'925.47	0.13	a)
XS2556930696	4.2500 % KOMMUN 4 1/4 11/17/25 EMTN	0	5'000	5'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
DK							1'028'491.10	0.19	
XS2532370231	4.0000 % ESTONI 4 10/12/32	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EE							0.00	0.00	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	0	5'000	0	5'000 EUR	84.75%	4'076'116.34	0.75	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	700	0	0	700 EUR	40.19%	270'632.31	0.05	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	7'000	0	7'000 EUR	65.66%	4'421'342.21	0.81	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	0	3'250	0	3'250 EUR	57.44%	1'795'724.78	0.33	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.
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	0	10'000	0	10'000 EUR	78.45%	7'546'218.85	1.39	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	1'150	350	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	2'400	0	0	2'400 EUR	72.72%	1'678'900.71	0.31	a)
ES0200002089	3.9000 % ADIFAL 3.9 04/30/33 EMTN	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	98.92%	2'854'700.28	0.53	a)
ES							22'643'635.48	4.17	
XS2230845328	0.0000 % FINNVE 0 09/15/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI							0.00	0.00	
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	0	3'750	3'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	0	2'000	0	2'000 EUR	80.68%	1'552'164.94	0.29	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	0	6'000	0	6'000 EUR	59.98%	3'461'781.84	0.64	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	0	3'250	1'050	2'200 EUR	98.85%	2'091'923.18	0.39	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	0	1'500	0	1'500 EUR	44.85%	647'136.19	0.12	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	89.14%	2'143'701.77	0.40	a)
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F6X7	3.5000 % SOGRPR 3 1/2 05/25/43 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	0	4'500	0	4'500 EUR	96.97%	4'197'511.49	0.77	a)
FR							14'094'219.41	2.60	
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	250	0	250	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B7Z53659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	800	200	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	0	1'200	0	1'200 GBP	56.68%	751'100.80	0.14	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	1'600	2'400	0	4'000 GBP	76.30%	3'370'324.12	0.62	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	0	2'000	0	2'000 GBP	32.77%	723'758.33	0.13	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	1'000	6'000	1'000	6'000 GBP	71.48%	4'736'122.57	0.87	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	3'100	2'150	1'250	4'000 GBP	46.69%	2'062'391.00	0.38	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	2'700	2'800	0	5'500 GBP	36.10%	2'192'587.99	0.40	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	0	4'250	500	3'750 GBP	83.84%	3'471'919.73	0.64	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	0	3'850	2'250	1'600 GBP	98.81%	1'745'836.73	0.32	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	400	0	400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	0	1'300	300	1'000 GBP	88.93%	982'054.14	0.18	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	1'700	4'250	1'200	4'750 GBP	69.55%	3'648'193.65	0.67	a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	1'600	0	0	1'600 GBP	95.87%	1'693'855.11	0.31	a)
GB							25'378'144.17	4.68	
IDG000009507	8.3750 % INDOGB 8 3/8 09/15/26 FR56	20'000'000	0	0	20'000'000 IDR	103.50%	1'185'886.81	0.22	a)
IDG000010307	6.1250 % INDOGB 6 1/8 05/15/28 FR64	16'800'000	0	0	16'800'000 IDR	96.48%	928'550.25	0.17	a)
ID							2'114'437.06	0.39	
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	4'000	0	0	4'000 ILS	95.67%	860'862.95	0.16	a)
IL							860'862.95	0.16	
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24 4Y	4'000	0	100	3'900 EUR	99.24%	3'722'852.60	0.69	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	750	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	0	4'000	0	4'000 EUR	61.96%	2'383'885.25	0.44	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	0	5'500	0	5'500 EUR	75.39%	3'988'475.19	0.73	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	1'500	2'000	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	5'000	1'100	6'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	0	7'000	2'500	4'500 EUR	82.95%	3'590'545.35	0.66	a)
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	3'000	0	0	3'000 EUR	93.03%	2'684'554.68	0.49	a)
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
IT							16'370'313.07	3.02	
JP1024221M37	0.1000 % JGB 0.1 03/01/23 422	725'000	0	725'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	800'000	300'000	100'000	1'000'000 JPY	100.04%	6'011'754.01	1.11	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.
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	0	2'200'000	0	2'200'000 JPY	100.12%	13'235'509.45	2.44	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	800'000	800'000	100'000	1'500'000 JPY	100.00%	9'013'214.32	1.66	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	800'000	800'000	0	1'600'000 JPY	99.41%	9'558'234.58	1.76	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	0	1'500'000	0	1'500'000 JPY	99.15%	8'936'868.57	1.65	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	1'500'000	1'325'000	1'250'000	1'575'000 JPY	98.18%	9'292'097.11	1.71	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	1'200'000	800'000	800'000	1'200'000 JPY	97.23%	7'011'189.18	1.29	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	600'000	600'000	1'200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	96.29%	5'786'352.29	1.07	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	0	1'100'000	1'100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	600'000	0	100'000	500'000 JPY	98.27%	2'952'546.15	0.54	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	350'000	650'000	0	1'000'000 JPY	88.48%	5'316'620.16	0.98	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	950'000	650'000	1'000'000	600'000 JPY	90.77%	3'272'717.54	0.60	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	84.13%	5'055'704.61	0.93	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	750'000	350'000	0	1'100'000 JPY	83.14%	5'495'769.76	1.01	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	550'000	150'000	0	700'000 JPY	77.99%	3'280'343.10	0.60	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	750'000	550'000	300'000	1'000'000 JPY	75.07%	4'511'159.06	0.83	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	250'000	100'000	0	350'000 JPY	68.34%	1'437'382.12	0.26	a)
XS0241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	1'000	300	0	1'300 GBP	88.96%	1'277'158.48	0.24	a)
XS2296155562	1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	75.40%	4'117'284.61	0.76	a)
JP							105'561'905.10	19.45	
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	4'500'000	0	0	4'500'000 KRW	94.94%	2'878'941.82	0.53	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	0	2'000'000	0	2'000'000 KRW	72.82%	981'372.92	0.18	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	1'000'000	2'500'000	0	3'500'000 KRW	67.14%	1'583'548.12	0.29	a)
KR103502GA67	1.3750 % KTB 1 3/8 06/10/30 3006	1'500'000	3'500'000	0	5'000'000 KRW	83.42%	2'810'551.30	0.52	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	0	2'000'000	0	2'000'000 KRW	91.59%	1'234'371.31	0.23	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	0	2'600	0	2'600 USD	99.90%	2'363'816.78	0.44	a)
XS2623871196	3.3750 % KDB 3 3/8 05/23/28 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
KR							11'852'602.25	2.18	
XS2547270756	4.1250 % LITHUN 4 1/8 04/25/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2604821228	3.8750 % LITHUN 3 7/8 06/14/33 EMTN	0	2'850	2'850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LT							0.00	0.00	
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	3'000	0	1'750	1'250 EUR	98.30%	1'182'003.52	0.22	a)
EU000A2SCAB4	0.8750 % EFSF 0 7/8 09/05/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	0	3'600	0	3'600 EUR	101.12%	3'501'686.41	0.65	a)
LU							4'683'689.93	0.86	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	200'000	410'000	130'000	480'000 MXN	99.68%	2'411'980.63	0.44	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	0	550'000	150'000	400'000 MXN	87.10%	1'756'276.68	0.32	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	0	200'000	100'000	100'000 MXN	79.90%	402'798.84	0.07	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	175'000	225'000	100'000	300'000 MXN	89.77%	1'357'643.61	0.25	a)
XS2363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
MX							5'928'699.76	1.09	
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	1'500	0	0	1'500 MYR	100.77%	288'721.45	0.05	a)
MYBMS1100036	4.3920 % MGS 4.392 04/15/26 0311	2'000	0	0	2'000 MYR	101.68%	388'434.44	0.07	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	3'000	0	0	3'000 MYR	99.25%	568'727.29	0.10	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	4'000	0	0	4'000 MYR	105.09%	802'937.42	0.15	a)
MY							2'048'820.60	0.38	
AU3CB0216141	5.2500 % BNG 5 1/4 05/20/24 MTN	400	0	400	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	94.43%	544'126.97	0.10	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	3'000	0	0	3'000 AUD	90.03%	1'556'219.04	0.29	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	74.77%	1'798'081.50	0.33	a)
XS1632891138	0.6250 % BNG 0 5/8 06/19/27 EMTN	1'250	0	0	1'250 EUR	91.25%	1'097'161.58	0.20	a)
XS1956184532	2.6250 % BNG 2 5/8 02/27/24 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	99.03%	3'604'999.27	0.66	a)
XS2101563646	1.7500 % NEDWBK 1 3/4 01/15/25 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	95.52%	3'477'264.65	0.64	a)
XS2226241854	0.1250 % NEDWBK 0 1/8 09/03/35	3'000	1'000	0	4'000 EUR	66.62%	2'563'457.73	0.47	a)
XS2290332985	0.1250 % NEDWBK 0 1/8 02/15/23 REGS	3'750	0	3'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	4'250	2'250	0	6'500 EUR	85.52%	5'346'970.62	0.99	a)
XS2436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	98.36%	5'370'478.07	0.99	a)
XS2468318154	2.0000 % BNG 2 04/12/24 EMTN	1'250	0	1'250	0 GBP	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.
X52485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	0	4'000	0	4'000 USD	98.42%	3'582'757.64	0.66	a)
NL							28'941'517.07	5.33	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	3'000	1'250	1'250	3'000 NOK	99.54%	243'246.97	0.04	a)
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	2'000	0	2'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	3'500	6'500	0	10'000 NOK	86.08%	701'218.41	0.13	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	5'000	0	5'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
X52014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	97.72%	889'337.26	0.16	a)
X52305738598	0.2500 % KBN 0 1/4 12/15/25 EMTN	0	1'000	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52537112059	3.7500 % KBN 3 3/4 09/26/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
NO							1'833'802.64	0.34	
NZGOVDT423C0	5.5000 % NZGB 5 1/2 04/15/23 0423	750	0	750	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	0	3'500	750	2'750 NZD	97.30%	1'416'414.53	0.26	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	750	0	750	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	500	2'250	250	2'500 NZD	56.01%	741'199.25	0.14	a)
X52353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	0	2'350	0	2'350 EUR	84.14%	1'902'075.88	0.35	a)
NZ							4'059'689.66	0.75	
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
PE							0.00	0.00	
PTOTECOEO037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	1'000	500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PT							0.00	0.00	
X52538441598	6.6250 % ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS	2'550	0	2'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
RO							0.00	0.00	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	2'000	0	0	2'000 SEK	104.56%	170'328.77	0.03	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	3'000	5'500	0	8'500 SEK	81.12%	561'616.51	0.10	a)
US50046PBN42	0.3750 % KOMINS 0 3/8 02/16/24 144A	0	6'000	0	6'000 USD	98.50%	5'378'395.50	0.99	a)
US87031CAH60	4.6250 % SEK 4 5/8 11/28/25 GMTN	0	3'000	0	3'000 USD	98.67%	2'693'720.13	0.50	a)
X52226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	3'000	0	0	3'000 SEK	83.04%	202'909.30	0.04	a)
X52284751810	0.2500 % SEK 0 1/4 07/14/23 EMTN	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52311395169	0.3750 % KOMINS 0 3/8 06/19/24 REGS	1'800	5'200	0	7'000 USD	96.72%	6'161'529.93	1.14	a)
X52412562600	0.5000 % KOMINS 0 1/2 07/05/23 REGS	0	8'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	98.14%	4'465'751.86	0.82	a)
SE							19'634'252.00	3.62	
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	600	0	0	600 SGD	96.43%	384'319.35	0.07	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	750	0	0	750 SGD	97.12%	483'836.66	0.09	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	0	1'200	0	1'200 SGD	88.18%	702'878.37	0.13	a)
SG							1'571'034.38	0.29	
X52635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	0	3'400	0	3'400 USD	95.20%	2'945'649.84	0.54	a)
SI							2'945'649.84	0.54	
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	3'500	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK							0.00	0.00	
TH0623035C07	3.8500 % THAIGB 3.85 12/12/25	20'000	20'000	0	40'000 THB	102.60%	1'039'148.32	0.19	a)
TH0623037C05	3.5800 % THAIGB 3.58 12/17/27	20'000	24'000	0	44'000 THB	102.84%	1'145'751.59	0.21	a)
TH0623A3B608	3.6500 % THAIGB 3.65 06/20/31	20'000	2'000	0	22'000 THB	103.42%	576'089.38	0.11	a)
TH							2'760'989.29	0.51	
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	3'000	0	0	3'000 USD	70.27%	1'918'356.82	0.35	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	3'250	0	0	3'250 USD	65.84%	1'947'435.91	0.36	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	13'500	3'500	10'000 USD	43.94%	3'998'532.19	0.74	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	11'000	9'500	8'500	12'000 USD	45.47%	4'965'460.31	0.91	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	3'000	14'000	3'000	14'000 USD	53.97%	6'875'996.53	1.27	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	6'750	11'250	4'000	14'000 USD	54.44%	6'935'718.56	1.28	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	3'000	2'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	6'750	5'500	3'250	9'000 USD	86.06%	7'048'906.03	1.30	a)
US912828ZP81	0.1250 % T 0 1/8 05/15/23	8'700	1'550	10'250	0 USD	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.
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	6'500	18'500	0	25'000 USD	76.22%	17'340'718.36	3.20	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	0	10'000	0	10'000 USD	84.72%	7'709'829.84	1.42	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	1'000	18'500	19'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	13'000	0	3'500	9'500 USD	90.23%	7'801'190.76	1.44	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	11'750	11'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	0	6'750	3'250	3'500 USD	96.84%	3'084'394.09	0.57	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	15'000	8'250	13'250	10'000 USD	83.73%	7'620'247.25	1.40	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	0	18'500	0	18'500 USD	84.02%	14'144'806.77	2.61	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	0	9'700	9'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	9'000	21'000	0	30'000 USD	76.75%	20'953'901.25	3.86	a)
US91282CEJ62	0.1250 % T 1 0 1/8 04/15/27	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	11'000	3'250	7'750 USD	89.52%	6'313'435.97	1.16	a)
US							118'658'930.64	21.86	
EU000A1Z6630	0.6250 % EU 0 5/8 11/04/23 EMTN	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A283867	0.1000 % EU 0.1 10/04/40 SURE	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A285VM2	0.0000 % EU 0 07/04/35 SURE	0	4'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4D66	0.0000 % EUB 0 11/10/23 6M	0	5'750	100	5'650 EUR	99.92%	5'430'320.61	1.00	a)
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DJ5	0.8000 % EU 0.8 07/04/25 NGEU	1'750	800	2'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	2'500	3'750	3'750	2'500 EUR	80.30%	1'931'043.82	0.36	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	0	5'500	750	4'750 EUR	94.79%	4'331'053.37	0.80	a)
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 SURE	0	6'000	0	6'000 EUR	83.63%	4'826'467.27	0.89	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	2'550	3'950	2'000	4'500 EUR	56.31%	2'437'344.33	0.45	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	0	2'250	2'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US298785HP47	2.5000 % EIB 2 1/2 03/15/23	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	0	6'000	0	6'000 EUR	82.87%	4'783'065.13	0.88	a)
XS							23'739'294.53	4.37	
Derivative Finanzinstrumente							-1'972'510.85	-0.36	
Futures							0.00	0.00	
12/22	EURO-BOBL FUTURE DEC22	-210	210	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 10YR NOTE (CBT)DEC22	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUXL 30Y BND MAR23	0	15	15	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR NOTE (CBT)MAR23	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	70	70	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUXL 30Y BND JUN23	0	15	15	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR NOTE (CBT)JUN23	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUXL 30Y BND SEP23	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 10YR NOTE (CBT)SEP23	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US ULTRA BOND CBT SEP23	0	30	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 5YR NOTE (CBT) SEP23	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	0	10	10	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	100	200	-100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	0	30	0	30 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US ULTRA BOND CBT DEC23	0	0	30	-30 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	0	100	0	100 USD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 02.05.2023		174'316'220	1'300'000	JPY/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		80'372'284	500'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		600'000	406'690	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		450'000	403'747	USD/CHF		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							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.
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	MXN/CHF Verfall 08.12.2022		845'614	17'100'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		2'571'155	4'050'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		36'393'138	5'400'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		38'381'953	38'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 08.12.2022		18'333	7'775'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		58'013'397	58'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		542'731	950'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		9'242'675	8'125'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.12.2022		280'395	3'100'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 08.12.2022		563'539	5'900'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 08.12.2022		427'475	10'650'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		13'842'261	101'950'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.12.2022		309'537	2'325'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 08.12.2022		788'454	30'400'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.12.2022		571'914	2'775'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		3'512'759	4'825'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.12.2022		647'409	925'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.12.2022		530'061	1'875'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		544'935	550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		394'316	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		114'109	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		1'100'000	28'861		THB/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		324'444	48'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		248'329	250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		346'347	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		127'500	200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		114'440	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		73'090	100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		862'203	875'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		896'067	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		199'887	175'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		843'513	125'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		95'740	700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		200'000	197'004		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		61'000'000	414'245		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		800'000	109'096		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		456'764	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		1'100'000	1'091'885		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		350'000	345'326		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		75'000	48'122		AUD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 08.12.2022		1'367'971	27'000'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		300'000	295'673		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		100'000	73'098		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		150'000	169'747		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		393'578	400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		947'186	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		333'962	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		439'932	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		650'000	86'120		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		285'139	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		342'286	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		112'971	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		498'666	73'250'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		1'587'607	1'400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		912'974	1'300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		1'147'838	1'800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		1'936'368	14'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		9'663'450	10'150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		5'982'197	6'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		5'952'399	871'850'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		844'894	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		639'990	650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		286'150	2'150'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		1'105'371	160'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 09.12.2022		2'013'893	2'900'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 09.12.2022		1'133'968	17'860'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 09.12.2022		17'860'000'000	1'077'325		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		2'900'000'000	2'068'432		KRW/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		48'228'918	48'950'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 19.01.2023		529'998	13'150'000		CHF/CZK	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.
	HUF/CHF Verfall 19.01.2023		23'427	10'000'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 19.01.2023		879'305	32'750'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.01.2023		12'244'481	10'700'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 19.01.2023		642'071	6'850'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.01.2023		47'017'510	6'834'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 19.01.2023		2'241'629	47'800'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 19.01.2023		574'802	2'100'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 19.01.2023		4'317'982	6'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		67'963'668	72'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 19.01.2023		3'923'025	6'250'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		16'016'889	119'350'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 19.01.2023		360'724	4'000'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 19.01.2023		650'656	1'100'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 19.01.2023		390'807	2'950'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 19.01.2023		688'795	1'000'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 19.01.2023		642'531	3'100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.01.2023		1'174'757	171'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		677'952	5'050'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		2'070'029	2'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		3'401'059	3'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.01.2023		227'983	200'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		150'000	171'807	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		400'000	368'140	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		1'300'000	1'478'610	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		1'682'475	1'700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		600'000	592'844	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		400'000	395'051	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 19.01.2023		200'000	124'059	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.01.2023		62'000'000	435'120	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		500'000	490'861	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		600'000	553'175	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		2'950'000	2'907'358	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 19.01.2023		5'400'000	717'741	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 19.01.2023		900'000	611'573	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.01.2023		112'500'000	791'826	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		2'750'000	2'551'656	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		600'000	553'936	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 19.01.2023		750'000	99'146	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		400'000	393'115	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 19.01.2023		1'200'000	105'914	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		200'000	197'321	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		640'014	650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		418'040	450'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		656'845	4'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		1'300'790	1'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 20.01.2023		1'067'518	17'860'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 20.01.2023		2'198'822	3'100'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 20.01.2023		17'860'000'000	1'088'122	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 20.01.2023		3'100'000'000	2'311'780	KRW/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.03.2023		637'310	6'850'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.03.2023		693'445	1'000'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.03.2023		540'952	13'150'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.03.2023		2'306'192	47'800'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		48'196'651	6'700'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.03.2023		650'219	3'100'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.03.2023		908'858	32'750'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.03.2023		567'573	2'100'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.03.2023		648'043	1'100'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.03.2023		247'176	2'800'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		16'773'006	123'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		47'962'088	48'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 16.03.2023		24'433	10'000'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		10'631'193	9'450'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		3'878'528	6'050'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.03.2023		293'493	2'200'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		67'569'205	73'850'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		3'694'518	5'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		957'268	1'050'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		680'664	5'050'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		1'184'539	1'200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		699'865	98'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.03.2023		266'215	450'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		868'951	950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		223'389	350'000	CHF/AUD		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.
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		681'057	600'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		796'391	800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		300'000	301'214	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		300'000	195'458	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		944'265	133'550'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		4'900'000	236'608	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		450'000	412'986	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		150'000	167'424	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		450'000	415'113	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		400'000	394'285	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		1'400'000	1'293'180	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		550'000	542'801	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.03.2023		106'250'000	732'356	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		100'000	112'082	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		127'544	18'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		148'429	150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		578'483	4'300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		1'800'000	1'684'391	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		250'000	157'835	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		50'000	56'667	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		2'250'000	2'234'750	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		9'650'000	491'531	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.03.2023		5'950'000	801'798	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.03.2023		365'000'000	2'512'167	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		1'650'000	85'429	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		350'000	393'483	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		650'000	648'986	EUR/CHF		0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.03.2023		1'165'353	19'250'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		2'375'332	3'200'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.03.2023		19'250'000'000	1'145'050	IDR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		3'200'000'000	2'243'048	KRW/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		72'452'529	79'950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		50'643'449	51'900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		11'516'412	10'450'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		49'264'107	7'228'150'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.05.2023		18'110'318	136'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.05.2023		3'814'637	6'300'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		3'981'816	6'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.05.2023		676'670	7'850'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.05.2023		373'373	4'300'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.05.2023		413'271	3'150'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.05.2023		958'895	1'700'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.05.2023		739'901	3'600'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.05.2023		602'060	14'800'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.05.2023		2'342'171	48'800'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 25.05.2023		58'447	24'050'000	CHF/HUF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.05.2023		743'261	1'100'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.05.2023		577'086	2'300'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.05.2023		971'577	37'050'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		606'780	89'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		908'647	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		684'389	700'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		545'230	550'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		800'000	733'856	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		699'742	100'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		650'000	596'266	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.05.2023		300'000	298'047	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.05.2023		450'000	301'948	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.05.2023		6'000'000	796'104	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.05.2023		3'950'000	3'912'973	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.05.2023		270'000	164'557	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.05.2023		350'000	14'678	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 25.05.2023		850'000	2'173	HUF/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 25.05.2023		1'000'000	568'287	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.05.2023		50'000	4'399	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.05.2023		7'800'000	389'154	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.05.2023		390'000'000	2'681'550	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.05.2023		100'000	21'066	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		4'300'000	3'901'799	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.05.2023		4'850'000	421'775	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.05.2023		750'000	20'127	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.05.2023		61'450'000	424'524	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		1'035'597	1'150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.05.2023		750'000	64'682	SEK/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 25.05.2023		450'000	59'235		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		900'000	805'714		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		150'000	166'175		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		200'000	221'903		GBP/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		278'663	250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 25.05.2023		25'000	6'144		ILS/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		369'550	375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		82'123	125'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		1'519'831	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.05.2023		50'000	4'204		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.05.2023		4'450'000	117'525		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.05.2023		50'000	4'215		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 25.05.2023		40'000	9'815		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.05.2023		50'000	33'234		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		150'000	168'484		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.05.2023		100'000	60'159		AUD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.05.2023		270'379	450'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		33'249	50'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.05.2023		140'990	1'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		1'853'522	280'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		888'532	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		1'317'188	1'350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		56'075	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.05.2023		1'276'524	21'815'150'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.05.2023		2'891'311	4'142'500'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.05.2023		820'000'000	50'338		IDR/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.05.2023		1'204'532	1'770'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.05.2023		5'912'500'000	4'042'102		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.05.2023		20'995'150'000	1'269'034		IDR/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		2'027'718	41'400'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		11'284'800	10'150'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		350'252	4'150'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		938'339	36'250'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		591'735	14'600'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.07.2023		731'634	1'100'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		237'722	2'900'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		3'767'118	6'350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 27.07.2023		59'212	23'550'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		16'900'870	132'950'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		758'986	3'550'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		69'721'782	78'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		47'804'906	7'340'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		49'204'674	50'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		3'745'837	5'650'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		396'097	3'050'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		447'161	800'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		6'222'432	960'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		9'836'057	10'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.07.2023		33'290	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		10'583	50'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		586'623	1'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		669'620	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		6'493	50'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		6'767'460	7'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		2'397'871	18'850'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		4'026	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		11'659	450'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		628'024	950'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		10'136	250'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		30'154	600'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 27.07.2023		896	350'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		1'328'132	10'450'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		134'533	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		12'991	100'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		12'257	300'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		2'540'417	390'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		4'066	50'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		2'998'608	3'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		1'345'896	1'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 27.07.2023		1'162	450'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		837'424	16'350'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		60'189	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		27'344	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		8'302	100'000		CHF/SEK	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.
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		10'724	50'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		15'604	600'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		3'795'196	4'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		1'645'441	265'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'744'942	1'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		113'509	100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		154'530	1'250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		1'709'197	1'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		270'415	400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.07.2023		750'000	730'107		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.07.2023		100'000	114'008		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		1'050'000	935'441		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 27.07.2023		400'000	234'669		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		336'750	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'073'959	1'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		1'009'935	1'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		544'505	2'250'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		12'142	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		12'202	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		4'015'490	5'900'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 28.07.2023		1'193'090	20'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		33'436	49'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 28.07.2023		88'191	1'480'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		103'806	150'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 28.07.2023		28'933	480'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 28.07.2023		21'960'000'000	1'272'660		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.07.2023		6'099'000'000	4'154'539		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		85'588'858	99'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		61'766'647	64'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		55'904'002	9'085'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		4'444'366	7'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.09.2023		14'327'116	12'950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		21'223'171	175'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 21.09.2023		454'816	850'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		4'960'155	7'600'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 21.09.2023		260'696	3'050'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 21.09.2023		365'592	4'400'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 21.09.2023		422'337	3'300'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 21.09.2023		812'231	3'800'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 21.09.2023		779'183	1'200'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		966'762	38'500'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 21.09.2023		567'998	2'450'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 21.09.2023		622'482	15'800'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		3'061'942	60'850'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	HUF/CHF Verfall 21.09.2023		61'860	25'050'000		CHF/HUF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		110'000'000	678'128		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 21.09.2023		250'000	611		HUF/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		700'000	666'462		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.09.2023		700'000	35'300		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		150'000	166'389		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		50'000	32'497		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		100'000	3'942		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		50'000	29'036		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		2'450'000	2'102'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		400'000	10'073		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		2'400'000	289'735		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		750'000	647'276		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		50'000	6'423		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		50'000	4'076		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		180'000'000	1'105'018		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 21.09.2023		100'000	52'951		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.09.2023		2'400'000	119'458		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 21.09.2023		50'000	32'539		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		250'000	142'661		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		4'650'000	4'052'717		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		7'100'000	865'632		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		350'000	228'368		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		550'000	46'774		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		150'000	31'927		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		100'000	8'504		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		200'000	16'282		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		2'950'000	2'816'884		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 21.09.2023		100'000	23'676		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		340'000'000	2'096'845		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		100'000	12'822		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 21.09.2023		1'000'000	2'394		HUF/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		650'000	25'553		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		600'000	664'074		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		1'550'000	39'187		THB/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		1'739'468	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		531'252	4'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		750'000	717'587		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		550'000	309'128		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		517'453	4'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		250'000	53'319		PLN/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		1'049'587	1'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		5'800'000	703'737		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		300'000	333'316		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 21.09.2023		100'000	65'211		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 21.09.2023		250'000	58'243		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 21.09.2023		1'950'000	4'839		HUF/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 21.09.2023		20'626	250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		424'193	750'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		3'150'000	79'600		THB/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		309'731	350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		350'000	27'953		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		1'300'000	51'380		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.09.2023		200'000	10'488		MXN/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		1'454'153	240'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 21.09.2023		730'229	1'400'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		250'000	32'011		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		194'770	300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		50'000	1'983		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		150'000	167'062		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		186'040	1'550'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		600'000	77'069		DKK/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		247'161	9'900'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		234'004	4'500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		334'989	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		398'108	700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		270'805	45'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		50'000	10'692		PLN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		568'710	650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		50'000	4'048		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HUF Verfall 21.09.2023		150'000	377		HUF/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		302'477	12'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 22.09.2023		1'233'222	21'500'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		4'174'288	6'150'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		1'083'347	1'600'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		390'000'000	262'220		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		650'000'000	437'710		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 22.09.2023		1'800'000'000	104'348		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		15'000'000	9'931		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 22.09.2023		90'000'000	5'181		IDR/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		3'195'165	61'800'000		CHF/MXN	92'460.07	0.02	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		220'560	2'650'000		CHF/NOK	4'927.98	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		12'960'133	11'750'000		CHF/GBP	4'628.93	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		359'204	2'800'000		CHF/DKK	-1'344.60	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		1'142'340	2'150'000		CHF/NZD	5'964.38	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		689'330	3'350'000		CHF/PLN	-32'907.88	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		58'013'843	60'700'000		CHF/EUR	-317'115.16	-0.06	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		4'945'317	7'450'000		CHF/CAD	68'334.41	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		82'771'697	93'050'000		CHF/USD	-1'766'294.18	-0.33	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		52'861'548	8'700'000'000		CHF/JPY	538'147.47	0.10	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		21'331'406	174'550'000		CHF/CNY	-299'859.82	-0.06	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		298'438	3'700'000		CHF/SEK	-2'637.93	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		532'343	13'650'000		CHF/CZK	-666.52	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		4'342'785	7'500'000		CHF/AUD	25'895.68	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		491'667	2'100'000		CHF/ILS	19'878.40	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		655'103	1'000'000		CHF/SGD	-8'493.69	0.00	b)
	HUF/CHF Verfall 16.11.2023		53'257	21'650'000		CHF/HUF	-900.10	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		1'391'220	56'250'000		CHF/THB	-33'557.53	-0.01	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		350'000	311'491		USD/CHF	6'491.99	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		90'000'000	547'168		JPY/CHF	-5'890.81	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		650'000	590'455		USD/CHF	93.02	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		273'541	300'000		CHF/USD	979.31	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		1'106'887	180'000'000		CHF/JPY	24'323.75	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		12'837	250'000		CHF/MXN	286.07	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		241'340	250'000		CHF/EUR	1'095.65	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		5'927	150'000		CHF/CZK	70.12	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		293'778	2'350'000		CHF/CNY	2'547.47	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		16'203	650'000		CHF/THB	-261.05	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		11'886	50'000		CHF/ILS	652.81	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		111'277	100'000		CHF/GBP	1'016.18	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		33'420	50'000		CHF/SGD	239.97	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		10'378	50'000		CHF/PLN	-401.47	0.00	b)
	HUF/CHF Verfall 16.11.2023		850	350'000		CHF/HUF	-25.39	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		100'000	57'887		AUD/CHF	-328.19	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		500'000	480'151		EUR/CHF	336.33	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		100'000	110'716		GBP/CHF	-455.59	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		60'000'000	369'942		JPY/CHF	-9'087.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		121'222	20'000'000		CHF/JPY	938.14	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		859'357	900'000		CHF/EUR	-5'516.67	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		858'172	950'000		CHF/USD	-4'933.72	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		220'755	200'000		CHF/GBP	235.67	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		650'000	614'373		EUR/CHF	10'253.43	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		150'000	163'342		GBP/CHF	2'045.65	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'300'000	1'164'810		USD/CHF	16'274.67	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		100'000'000	598'637		JPY/CHF	2'774.78	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		100'000	108'609		GBP/CHF	1'649.66	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		234'911	1'100'000		CHF/PLN	-2'248.39	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		166'230	1'350'000		CHF/CNY	-1'071.34	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		131'796	200'000		CHF/SGD	-924.31	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		4'042	50'000		CHF/NOK	-26.88	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		109'456	100'000		CHF/GBP	-803.48	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		65'058	100'000		CHF/CAD	-404.39	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		4'053	50'000		CHF/SEK	-15.91	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		138'899	23'000'000		CHF/JPY	573.70	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		100'000	57'269		AUD/CHF	289.05	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		1'532'006	1'700'000		CHF/USD	-12'496.34	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		47'233	950'000		CHF/MXN	-461.24	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		185'372	1'450'000		CHF/DKK	-1'339.64	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		8'715	350'000		CHF/THB	-150.05	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		1'001'708	1'050'000		CHF/EUR	-7'310.11	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		2'087'799	16'850'000		CHF/CNY	-373.29	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		449'104	11'500'000		CHF/CZK	47.51	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		7'723'619	8'500'000		CHF/USD	1'059.90	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		183'094	2'250'000		CHF/SEK	5.66	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'067	300'000		CHF/MXN	5.97	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		6'390'750	6'650'000		CHF/EUR	264.75	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		26'427	50'000		CHF/NZD	-0.04	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		518'033	900'000		CHF/AUD	8.36	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		10'125	400'000		CHF/THB	-6.73	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		288'878	3'550'000		CHF/NOK	17.70	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		4'419'555	735'000'000		CHF/JPY	-836.05	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		1'819'452	1'650'000		CHF/GBP	168.58	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		864'553	15'000'000'000		CHF/IDR	7'028.14	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		4'002'668	6'000'000'000		CHF/KRW	-36'901.21	-0.01	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		900'000	1'350'000'000		CHF/KRW	-8'902.71	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		263'312	4'500'000'000		CHF/IDR	6'051.25	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		150'000'000	101'554		KRW/CHF	-563.37	0.00	b)
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		75'000'000	4'379		IDR/CHF	-91.38	0.00	b)
	CHF/IDR Verfall 17.11.2023		80'000'000	4'532		IDR/CHF	41.22	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		26'570	40'000'000		CHF/KRW	-360.86	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 17.11.2023		8'484	150'000'000		CHF/IDR	-90.97	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		67'162	100'000'000		CHF/KRW	-164.37	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-1'718'116.58	-0.32	

Swaps

							-254'394.27	-0.05	
08/27	IRS FIX LEG 1.5768% P.A. EUR	15'000	0	15'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
08/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-15'000	15'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/27	IRS FIX LEG 2.41502% P.A. EUR	7'500	0	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
09/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-7'500	7'500	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/28	IRS FIX LEG 3.37% P.A. EUR	0	23'000	0	23'000 EUR	100.47%	22'228'095.06	4.10	b)
09/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	0	0	23'000	-23'000 EUR	100.00	-22'124'314.33	-4.08	b)
06/33	IRS FIX LEG 0.56925% P.A. JPY	0	1'200'000	0	1'200'000 JPY	95.03%	6'852'757.00	1.26	b)
06/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'200'000	-1'200'000 JPY	100.00	-7'210'932.00	-1.33	b)

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	13'436'822.36	2.48
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	528'371'785.30	97.36
Derivative Finanzinstrumente	-1'972'510.85	-0.36
Sonstige Vermögenswerte	2'863'606.13	0.53
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	542'699'702.94	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-42'757'008.38	
Andere Verbindlichkeiten	-34'018.82	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	499'908'675.74	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	528'371'785.30	97.36
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'972'510.85	-0.36
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	127'653'815.38	23.52
------------------------------	-----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				127'653'815.38	23.52
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	750 CHF	99.51%	746'325.00	0.14
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	2'875 EUR	80.15%	2'216'579.74	0.41
EU000A3K4D66	0.0000 % EUB 0 11/10/23 6M	4'920 EUR	99.92%	4'728'703.96	0.87
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	650 EUR	94.79%	592'670.46	0.11
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	1'500 EUR	56.31%	812'448.11	0.15
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	2'000 EUR	80.68%	1'552'164.94	0.29
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	6'000 EUR	59.98%	3'461'781.84	0.64
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	2'050 EUR	98.85%	1'949'292.05	0.36
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	1'500 EUR	44.85%	647'136.19	0.12
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	3'000 GBP	46.69%	1'546'793.25	0.29
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	2'000 GBP	36.10%	797'304.72	0.15
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	1'200 GBP	98.81%	1'309'377.55	0.24
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	3'000 USD	70.27%	1'918'356.82	0.35
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	3'250 USD	65.84%	1'947'435.91	0.36
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	9'970 USD	43.94%	3'986'536.59	0.73
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	9'000 USD	45.47%	3'724'095.23	0.69
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	14'000 USD	53.97%	6'875'996.53	1.27
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	13'970 USD	54.44%	6'920'856.31	1.28
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	9'000 USD	86.06%	7'048'906.03	1.30
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	18'250 USD	76.22%	12'658'724.41	2.33
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	5'000 USD	84.72%	3'854'914.92	0.71
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	9'500 USD	90.23%	7'801'190.76	1.44
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	2'500 USD	96.84%	2'203'138.63	0.41
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	3'861 USD	83.73%	2'942'177.46	0.54
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	12'497 USD	84.02%	9'555'008.12	1.76
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	30'000 USD	76.75%	20'953'901.25	3.86
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	7'750 USD	89.52%	6'313'435.97	1.16
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	6'000 EUR	82.87%	4'783'065.13	0.88
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	4'000 EUR	98.90%	3'805'497.50	0.70

Collateral Accounts		
OTC COLLATERAL IV-BFINT2 USD ZKB	340'000 USD	309'417.00

OTC Gegenparteien		
Zürcher Kantonalbank		

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57619816
CAD	1 = CHF	0.65553755
CNY	1 = CHF	0.12395040
CZK	100 = CHF	3.91352000
DKK	100 = CHF	12.88776200
EUR	1 = CHF	0.96192671
GBP	1 = CHF	1.10430017
HUF	100 = CHF	0.25122000
IDR	10'000 = CHF	0.57290000
ILS	1 = CHF	0.22495087
JPY	100 = CHF	0.60091100
KRW	1 = CHF	0.00067384
MXN	1 = CHF	0.05040990
MYR	1 = CHF	0.19100640
NOK	100 = CHF	8.14603000
NZD	1 = CHF	0.52933058
PLN	1 = CHF	0.21595871
SEK	100 = CHF	8.14533700
SGD	1 = CHF	0.66424583
THB	100 = CHF	2.53196100
USD	1 = CHF	0.91005000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	48'360'627.85	36.077
Bond	CHF	85'688'548.79	63.923
Total	CHF	134'049'176.64	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	45'875'052.22	9.177
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	297'602'882.70	59.531

6 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	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NT USD	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

7 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	127'653'815.38
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.11.2022 - 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	0.950	1.200	0.750	0.200	2.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000

Periode: 27.03.2023 - 30.04.2023

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

9 Benchmark

Bloomberg Global Treasury ex JPY Total Return Index Unhedged CHF

10 TER

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

11 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	Ja	CHF	0.10000	0.03500	0.06500

12 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	Ja	CHF	0.45946	0.16081	0.29865
NT CHF	Ja	CHF	12.502	4.375	8.127
NT USD	Ja	CHF	0.70671	0.24734	0.45937
NTH1 CHF	Ja	CHF	0.89430	0.31300	0.58130

13 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

14 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