

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CHF

Jahresbericht per 31.10.2023

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

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

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 23. Februar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Fund I,

mit den Teilvermögen

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

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	24
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	24
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	24
7	Pauschale Verwaltungskommission	25
8	Benchmark	25
9	TER	25
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	26
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	26
12	Fussnoten	26
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	27
14	Pflichtpublikationen	29

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'496'577'565.64	3'159'582'238.76	2'869'261'027.83	2'563'210'283.20
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'278'663.18	813'291.94	1'100'763.39	672'244.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'177.519	9'273.691	11'193.233	6'661.171
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.1895	87.6988	98.3419	100.9199
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.9460	87.9795	98.2632	101.1924
Ausschüttung je Anteil		0.15	-	0.20	-
Total Expense Ratio (TER)		0.75 %	0.75 %	0.75 %	0.78 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		27'089'269.35			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		261'280.325			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.6789			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.3990			
Ausschüttung je Anteil		0.35			
Total Expense Ratio (TER)		0.48 %			
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		48'800'456.65	35'825'097.13	39'741'544.92	41'243'247.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		526'779.807	398'689.491	396'167.653	401'525.574
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.6392	89.8571	100.3150	102.7200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.3891	90.1447	100.2347	102.9937
Thesaurierung je Anteil		0.39	0.13	0.18	0.22
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'084'284.27	5'553'157.32	1'736'100.83	467'955.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		11'954.045	5'666.954	1'587.999	418.299
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'010.8950	979.9193	1'093.2632	1'118.7097
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'008.1656	983.0550	1'092.3886	1'121.7302
Thesaurierung je Anteil		5.33	2.47	3.11	3.55
Total Expense Ratio (TER)		0.35 %	0.35 %	0.35 %	0.35 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		928'900'915.37	975'640'158.97	980'708'587.77	953'632'921.26
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'940'682.442	10'775'657.227	9'713'030.731	9'234'221.964
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.4444	90.5411	100.9683	103.2716
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		93.1921	90.8309	100.8876	103.5504
Thesaurierung je Anteil		0.55	0.29	0.35	0.39
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %

	von	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
Klasse MT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'250'108.09	2'176'351.01	2'422'627.49	2'471'587.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		25'000.000	25'000.000	25'000.000	25'000.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.0043	87.0540	96.9051	98.8635
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.7613	87.3326	96.8276	99.1304
Thesaurierung je Anteil		0.78	0.54	0.61	0.45
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'476'173'868.73	2'139'574'182.39	1'843'551'403.43	1'564'722'327.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'837'280.638	1'641'330.839	1'270'475.073	1'056'187.612
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'347.7385	1'303.5606	1'451.0725	1'481.4814
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'344.0996	1'307.7320	1'449.9116	1'485.4814
Thesaurierung je Anteil		11.74	8.13	9.27	9.84
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Die in diesem Bericht enthaltenen Zahlen und Angaben sind vergangenheitsbezogen. Diese dürfen nicht als Garantie für die zukünftige Entwicklung verstanden werden.

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	2.24 %	-12.17 %	-2.40 %	0.37 %
Klasse BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	3.40 %	-0.65 %	-	-
Klasse CT CHF	2.54 %	-11.91 %	-2.11 %	0.69 %
Klasse DT CHF	3.25 %	-11.54 %	-2.01 %	0.79 %
Klasse GT CHF	3.32 %	-11.47 %	-1.94 %	0.86 %
Klasse MT CHF (Lancierung 17.02.2020)	3.00 %	-11.51 %	-1.67 %	-0.67 %
Klasse NT CHF	3.61 %	-11.23 %	-1.67 %	1.15 %
Benchmark	2.99 %	-12.10 %	-1.82 %	0.90 %
Tracking Error 33)	0.55 %	0.62 %	0.25 %	0.40 %

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 BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	0.41 %
Klasse CT CHF	-0.45 %
Klasse DT CHF	0.26 %
Klasse GT CHF	0.33 %
Klasse MT CHF (Lancierung 17.02.2020)	0.01 %
Klasse NT CHF	0.62 %

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	58'286'821.32	10'915'138.61
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'418'399'533.54	3'129'995'280.00
Derivative Finanzinstrumente	-1'410'848.75	4'884'208.90
Sonstige Vermögenswerte	21'564'288.01	14'033'566.63
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'496'839'794.12	3'159'828'194.14
Andere Verbindlichkeiten	-262'228.48	-245'955.38
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'496'577'565.64	3'159'582'238.76

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'273.691	11'193.233
Ausgegebene Anteile		6'128.484	1'557.631
Zurückgenommene Anteile		-1'224.656	-3'477.173
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		14'177.519	9'273.691

Klasse BA CHF	von bis	Lancierung 27.12.2022 31.10.2023	
Ausgegebene Anteile		291'853.452	
Zurückgenommene Anteile		-30'573.127	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		261'280.325	

Klasse CT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		398'689.491	396'167.653
Ausgegebene Anteile		212'810.936	86'773.742
Zurückgenommene Anteile		-84'720.620	-84'251.904
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		526'779.807	398'689.491

Klasse DT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'666.954	1'587.999
Ausgegebene Anteile		7'197.730	5'330.829
Zurückgenommene Anteile		-910.639	-1'251.874
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		11'954.045	5'666.954

Klasse GT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'775'657.227	9'713'030.731
Ausgegebene Anteile		1'816'847.556	4'178'798.906
Zurückgenommene Anteile		-2'651'822.341	-3'116'172.410
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'940'682.442	10'775'657.227

Klasse MT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		25'000.000	25'000.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		25'000.000	25'000.000

Klasse NT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'641'330.839	1'270'475.073
Ausgegebene Anteile		175'522.378	443'613.607
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		139'468.800	31'253.069
Zurückgenommene Anteile		-88'103.312	-89'231.071
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-30'938.067	-14'779.839
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'837'280.638	1'641'330.839

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	23.11.2022	184'000'217.90	138'416.975
Klasse NT CHF	02.12.2022	1'404'760.88	1'051.825

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	11.08.2023	41'343'460.88	30'938.067

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'159'582'238.76	2'869'261'027.83
Ausbezahlte Ausschüttung		0.00	-1'706.14
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-6'312'397.60	-6'022'495.07
Saldo aus dem Anteilverkehr		227'982'335.44	623'695'856.10
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		115'325'389.04	-327'350'443.96
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'496'577'565.64	3'159'582'238.76

Erfolgsrechnung

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		51'877.82	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-260'312.96
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		30'482'481.24	18'708'884.69
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'219'827.87	1'797'432.63
Total Ertrag		31'754'186.93	20'246'004.36
Aufwand			
Passivzinsen		-15.15	0.00
Reglementarische Vergütungen		-2'967'509.90	-2'754'645.45
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'267'156.53	-871'929.42
Total Aufwand		-4'234'681.58	-3'626'574.87
Nettoertrag / Verlust		27'519'505.35	16'619'429.49
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-81'149'908.08	-48'561'590.29
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		1'480'179.48	2'125'480.03
Realisierter Erfolg		-52'150'223.25	-29'816'680.77
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		167'475'612.29	-297'533'763.19
Gesamterfolg		115'325'389.04	-327'350'443.96

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	2'084.93	-1'519.44
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	0.00	1'519.44
Vortrag des Vorjahres	701.61	701.61
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'786.54	701.61
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	2'126.63	0.00
Vortrag auf neue Rechnung	659.91	701.61
Total	2'786.54	701.61
Klasse BA CHF	31.10.2023	
Nettoertrag	96'727.54	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	96'727.54	
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	91'448.12	
Vortrag auf neue Rechnung	5'279.42	
Total	96'727.54	
Klasse CT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	209'648.58	52'654.08
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	209'648.58	52'654.08
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	73'377.00	18'428.93
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	136'271.58	34'225.15
Total	209'648.58	52'654.08
Klasse DT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	63'801.90	14'053.20
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	63'801.90	14'053.20
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	22'330.67	4'918.62
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	41'471.23	9'134.58
Total	63'801.90	14'053.20
Klasse GT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	5'543'566.10	3'193'494.43
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'543'566.10	3'193'494.43
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'940'248.14	1'117'723.05
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'603'317.96	2'075'771.38
Total	5'543'566.10	3'193'494.43
Klasse MT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	19'613.62	13'576.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	19'613.62	13'576.53
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'864.77	4'751.79
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	12'748.85	8'824.74
Total	19'613.62	13'576.53
Klasse NT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	21'584'062.68	13'347'170.69
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	21'584'062.68	13'347'170.69
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'554'421.94	4'671'509.74
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	14'029'640.74	8'675'660.95
Total	21'584'062.68	13'347'170.69

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							3'418'399'533.54	97.76	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							3'418'399'533.54	97.76	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	93.15%	1'863'000.00	0.05	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	94.25%	6'597'500.00	0.19	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	5'400	0	0	5'400 CHF	97.45%	5'262'300.00	0.15	a)
AE							13'722'800.00	0.39	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	3'330	0	3'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'000	0	0	1'000 CHF	117.60%	1'176'000.00	0.03	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	97.93%	7'344'750.00	0.21	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	85.50%	2'565'000.00	0.07	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	85.00%	6'800'000.00	0.19	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.20%	3'036'000.00	0.09	a)
AT							20'921'750.00	0.60	
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMTN	1'775	0	1'775	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	0	3'190	3'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	1'775	0	1'775	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.00%	1'940'000.00	0.06	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	93.65%	1'873'000.00	0.05	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	6'400	2'000	0	8'400 CHF	97.80%	8'215'200.00	0.23	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	9'000	0	7'000	2'000 CHF	99.02%	1'980'400.00	0.06	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	6'530	2'000	0	8'530 CHF	95.60%	8'154'680.00	0.23	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	5'000	0	3'000	2'000 CHF	94.35%	1'887'000.00	0.05	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.25%	1'785'000.00	0.05	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	3'500	0	2'500	1'000 CHF	91.10%	911'000.00	0.03	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	7'500	0	2'400	5'100 CHF	87.35%	4'454'850.00	0.13	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	93.80%	1'782'200.00	0.05	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	8'150	0	0	8'150 CHF	98.60%	8'035'900.00	0.23	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'000	0	0	2'000 CHF	100.60%	2'012'000.00	0.06	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	4'000	0	4'000 CHF	101.75%	4'070'000.00	0.12	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	12'000	0	12'000 CHF	101.55%	12'186'000.00	0.35	a)
AU							59'287'230.00	1.70	
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 CHF	98.23%	4'911'500.00	0.14	a)
BM							4'911'500.00	0.14	
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	0	3'350	3'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	96.60%	4'830'000.00	0.14	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	3'100	0	0	3'100 CHF	89.20%	2'765'200.00	0.08	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	93.25%	2'797'500.00	0.08	a)
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	12'250	0	1'000	11'250 CHF	97.05%	10'918'125.00	0.31	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	93.60%	1'404'000.00	0.04	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	94.40%	2'832'000.00	0.08	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	5'000	7'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	5'000	12'000	3'000	14'000 CHF	94.60%	13'244'000.00	0.38	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	0	595	0	595 CHF	95.45%	567'927.50	0.02	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	5'000	0	0	5'000 CHF	97.90%	4'895'000.00	0.14	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	94.85%	4'742'500.00	0.14	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.15%	5'057'500.00	0.14	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	1'000	0	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.03	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.25%	5'012'500.00	0.14	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	101.90%	2'547'500.00	0.07	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.70%	5'085'000.00	0.15	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	101.05%	3'536'750.00	0.10	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	3'000	0	3'000 CHF	103.00%	3'090'000.00	0.09	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.85%	5'042'500.00	0.14	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.15	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.35%	4'054'000.00	0.12	a)
CA							88'502'502.50	2.53	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	5'900	0	5'000	900 CHF	161.50%	1'453'500.00	0.04	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	9'400	11'400	5'000	15'800 CHF	100.65%	15'902'700.00	0.45	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	10'000	7'500	17'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	0	5'500	0	5'500 CHF	100.85%	5'546'750.00	0.16	a)
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	3'000	0	0	3'000 CHF	106.01%	3'180'300.00	0.09	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	6'000	0	0	6'000 CHF	103.35%	6'201'000.00	0.18	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	6'500	0	5'000	1'500 CHF	104.35%	1'565'250.00	0.04	a)
CH0116712644	2.0000 % RAIFFS 2 09/21/23	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	30'300	10'000	1'000	39'300 CHF	101.30%	39'810'900.00	1.14	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	2'200	12'800	2'200	12'800 CHF	100.65%	12'883'200.00	0.37	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'250	0	0	8'250 CHF	102.70%	8'472'750.00	0.24	a)
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	2'400	0	0	2'400 CHF	101.00%	2'424'000.00	0.07	a)
CH0122526608	2.6250 % ENAG 2 5/8 01/31/23	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	5'100	0	3'100	2'000 CHF	103.07%	2'061'400.00	0.06	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	0	7'000	4'000	3'000 CHF	106.50%	3'195'000.00	0.09	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	0	30'000	11'309	18'691 CHF	108.88%	20'350'760.80	0.58	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	5'000	0	0	5'000 CHF	104.94%	5'247'000.00	0.15	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	5'000	0	0	5'000 CHF	107.30%	5'365'000.00	0.15	a)
CH0130501304	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 06/09/23	6'450	4'000	10'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	7'250	0	7'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	2'800	0	0	2'800 CHF	99.79%	2'794'120.00	0.08	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	3'000	0	0	3'000 CHF	100.20%	3'006'000.00	0.09	a)
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	24'000	0	6'000	18'000 CHF	99.85%	17'973'000.00	0.51	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42	0	1'500	0	1'500 CHF	104.55%	1'568'250.00	0.04	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	9'750	0	0	9'750 CHF	99.50%	9'701'250.00	0.28	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	0	2'000	0	2'000 CHF	100.00%	2'000'000.00	0.06	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	11'000	0	2'600	8'400 CHF	95.10%	7'988'400.00	0.23	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	4'850	0	4'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	4'200	0	0	4'200 CHF	95.65%	4'017'300.00	0.11	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	4'790	5'000	5'000	4'790 CHF	99.63%	4'772'277.00	0.14	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	17'400	0	9'000	8'400 CHF	99.90%	8'391'600.00	0.24	a)
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	9'750	0	9'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	3'000	0	1'000	2'000 CHF	99.40%	1'988'000.00	0.06	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194958960	3.0000 % KWLILJ 3 09/27/52	1'400	0	0	1'400 CHF	106.25%	1'487'500.00	0.04	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.
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	7'300	0	0	7'300 CHF	95.45%	6'967'850.00	0.20	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	11'000	0	8'000	3'000 CHF	97.90%	2'937'000.00	0.08	a)
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	0	2'250	0	2'250 CHF	99.50%	2'238'750.00	0.06	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	10'000	2'200	12'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'500	0	0	1'500 CHF	102.00%	1'530'000.00	0.04	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	4'500	0	0	4'500 CHF	101.65%	4'574'250.00	0.13	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	10'550	5'000	0	15'550 CHF	99.84%	15'525'120.00	0.44	a)
CH0212184078	1.8750 % SLHNVX 1 7/8 06/21/23	9'000	1'500	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	3'000	0	0	3'000 CHF	101.20%	3'036'000.00	0.09	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'500	0	0	1'500 CHF	101.25%	1'518'750.00	0.04	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	12'000	0	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	5'000	0	0	5'000 CHF	130.46%	6'523'000.00	0.19	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	4'000	3'500	0	7'500 CHF	96.71%	7'253'250.00	0.21	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	10'000	0	2'500	7'500 CHF	83.94%	6'295'500.00	0.18	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	5'000	10'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	0	1'000	0	1'000 CHF	104.55%	1'045'500.00	0.03	a)
CH0224761517	1.8750 % SIKASW 1 7/8 11/14/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	5'000	1'000	5'000	1'000 CHF	99.96%	999'600.00	0.03	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'500	0	0	4'500 CHF	99.89%	4'495'050.00	0.13	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLLIL 2 3/8 12/10/26	3'550	0	0	3'550 CHF	100.85%	3'580'175.00	0.10	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	4'000	10'000	0	14'000 CHF	99.85%	13'979'000.00	0.40	a)
CH0236868843	1.3750 % THURBK 1 3/8 08/28/23	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	1'000	12'550	0	13'550 CHF	99.89%	13'535'095.00	0.39	a)
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	500	1'300	0	1'800 CHF	99.71%	1'794'780.00	0.05	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	100	1'600	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	16'500	0	1'500	15'000 CHF	99.55%	14'932'500.00	0.43	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	0	0	1'000 CHF	99.75%	997'500.00	0.03	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	0	2'700	0	2'700 CHF	101.15%	2'731'050.00	0.08	a)
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	1'500	0	0	1'500 CHF	100.10%	1'501'500.00	0.04	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	3'000	0	0	3'000 CHF	97.60%	2'928'000.00	0.08	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	5'550	650	0	6'200 CHF	99.27%	6'154'740.00	0.18	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLLIL 1 1/4 09/11/24	0	700	0	700 CHF	99.13%	693'910.00	0.02	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	5'000	10'000	1'500	13'500 CHF	97.70%	13'189'500.00	0.38	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254284778	1.0000 % COOPSW 1 09/29/23	10'200	6'600	16'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	5'000	10'000	0	15'000 CHF	97.05%	14'557'500.00	0.42	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	25'000	3'165	17'500	10'665 CHF	99.06%	10'564'749.00	0.30	a)
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	5'000	3'000	800	7'200 CHF	99.67%	7'176'240.00	0.21	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	10'400	0	5'000	5'400 CHF	97.40%	5'259'600.00	0.15	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	11'000	0	0	11'000 CHF	98.69%	10'855'900.00	0.31	a)
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	10'000	0	7'200	2'800 CHF	94.00%	2'632'000.00	0.08	a)
CH0268988174	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 04/17/23	6'500	0	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	6'250	0	6'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	0	3'000	0	3'000 CHF	93.75%	2'812'500.00	0.08	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	8'500	0	2'000	6'500 CHF	95.41%	6'201'650.00	0.18	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275776430	1.1250 % ISHZ 1 1/8 04/17/23	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	10'740	0	3'000	7'740 CHF	90.30%	6'989'220.00	0.20	a)
CH0279135310	0.2500 % SGSNVX 0 1/4 05/08/23	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	7'100	0	0	7'100 CHF	97.75%	6'940'250.00	0.20	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	2'500	2'000	0	4'500 CHF	89.08%	4'008'600.00	0.11	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	13'900	0	13'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	0	1'500	0	1'500 CHF	98.70%	1'480'500.00	0.04	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	21'000	0	17'000	4'000 CHF	84.89%	3'395'600.00	0.10	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	0	8'500	8'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285509334	2.1250 % ALPHSW 2 1/8 06/30/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	5'000	0	0	5'000 CHF	96.65%	4'832'500.00	0.14	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	800	0	0	800 CHF	98.40%	787'200.00	0.02	a)
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	1'900	1'000	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293173453	1.2500 % LONNVX 1 1/4 09/22/23	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	20'080	0	20'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	20'800	0	0	20'800 CHF	90.65%	18'855'200.00	0.54	a)
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	12'000	0	0	12'000 CHF	94.20%	11'304'000.00	0.32	a)
CH0304749218	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 12/16/22	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256435	0.5000 % PPSNSW 0 1/2 02/16/24	11'000	4'000	0	15'000 CHF	99.48%	14'922'000.00	0.43	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	12'000	0	0	12'000 CHF	86.60%	10'392'000.00	0.30	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	20'150	0	20'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0317921663	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 03/31/28	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403702	1.5000 % KWLIU 1 1/2 12/06/22	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403777	0.3750 % PPSNSW 0 3/8 04/29/26	1'460	0	0	1'460 CHF	96.40%	1'407'440.00	0.04	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	4'000	0	0	4'000 CHF	85.53%	3'421'200.00	0.10	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	3'800	8'000	8'800	3'000 CHF	94.35%	2'830'500.00	0.08	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPIZ 0 3/4 07/28/36	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	0	4'000	0	4'000 CHF	77.25%	3'090'000.00	0.09	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	7'300	7'700	0	15'000 CHF	99.88%	14'982'000.00	0.43	a)
CH0330143170	0.0000 % PPSNSW 0 09/01/23	4'985	0	4'985	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	1'000	0	0	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.03	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	7'500	0	0	7'500 CHF	80.34%	6'025'500.00	0.17	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	5'000	0	0	5'000 CHF	97.30%	4'865'000.00	0.14	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	8'500	0	0	8'500 CHF	77.45%	6'583'250.00	0.19	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	0	12'250	0	12'250 CHF	72.53%	8'884'925.00	0.25	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	3'455	0	3'455 CHF	98.87%	3'415'958.50	0.10	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	24'500	6'000	12'500	18'000 CHF	95.14%	17'125'200.00	0.49	a)
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	0	2'500	0	2'500 CHF	95.55%	2'388'750.00	0.07	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	20'000	0	1'500	18'500 CHF	86.65%	16'030'250.00	0.46	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	0	3'000	0	3'000 CHF	75.60%	2'268'000.00	0.06	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	3'700	0	0	3'700 CHF	93.85%	3'472'450.00	0.10	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	0	2'000	0	2'000 CHF	76.95%	1'539'000.00	0.04	a)
CH0343366776	0.0000 % GIVNVX 0 12/07/22	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	5'000	0	0	5'000 CHF	88.65%	4'432'500.00	0.13	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	10'000	0	0	10'000 CHF	83.23%	8'323'000.00	0.24	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	20'000	9'000	8'700	20'300 CHF	86.58%	17'575'740.00	0.50	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	1'000	2'500	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	3'000	2'000	1'000 CHF	95.05%	950'500.00	0.03	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	3'400	0	3'400 CHF	96.85%	3'292'900.00	0.09	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	8'800	3'950	3'800	8'950 CHF	95.30%	8'529'350.00	0.24	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLIU 2 12/11/23	2'000	7'500	0	9'500 CHF	99.96%	9'496'200.00	0.27	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	10'000	0	1'000	9'000 CHF	86.15%	7'753'500.00	0.22	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	10'750	0	10'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	300	1'000	300	1'000 CHF	96.95%	969'500.00	0.03	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	10'800	0	800	10'000 CHF	95.56%	9'556'000.00	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.
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	3'300	0	0	3'300 CHF	98.78%	3'259'740.00	0.09	a)
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	0	1'000	0	1'000 CHF	90.55%	905'500.00	0.03	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	5'000	0	0	5'000 CHF	88.75%	4'437'500.00	0.13	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	10'000	0	0	10'000 CHF	95.40%	9'540'000.00	0.27	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	5'180	0	0	5'180 CHF	86.25%	4'467'750.00	0.13	a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	20'200	0	20'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	0	2'000	0	2'000 CHF	94.85%	1'897'000.00	0.05	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	3'060	0	3'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	5'000	2'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	0	5'000	3'000	2'000 CHF	94.59%	1'891'800.00	0.05	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	3'700	0	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476164	0.7500 % SCMNWX 0 3/4 11/24/33	3'475	0	3'475	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	5'500	0	700	4'800 CHF	89.55%	4'298'400.00	0.12	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	0	0	1'000 CHF	94.60%	946'000.00	0.03	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	21'000	1'000	7'000	15'000 CHF	95.37%	14'305'500.00	0.41	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	3'500	2'000	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476628	0.5000 % ALLNSW 0 1/2 04/19/23 0	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	4'900	3'000	0	7'900 CHF	97.75%	7'722'250.00	0.22	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	19'000	0	1'000	18'000 CHF	94.76%	17'056'800.00	0.49	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	0	4'000	0	4'000 CHF	92.70%	3'708'000.00	0.11	a)
CH0373476768	1.2500 % GRANDX 1 1/4 06/06/23	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476784	0.5000 % KBSh 0 1/2 05/31/28	2'500	0	0	2'500 CHF	94.75%	2'368'750.00	0.07	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	10'000	0	5'000	5'000 CHF	95.08%	4'754'000.00	0.14	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	2'000	7'950	0	9'950 CHF	98.84%	9'834'580.00	0.28	a)
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	0	1'000	0	1'000 CHF	85.75%	857'500.00	0.02	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'500	0	0	1'500 CHF	95.60%	1'434'000.00	0.04	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'500	10'300	0	11'800 CHF	92.35%	10'897'300.00	0.31	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	3'255	0	0	3'255 CHF	99.40%	3'235'470.00	0.09	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	2'000	1'000	2'000	1'000 CHF	99.19%	991'900.00	0.03	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	4'200	0	2'000	2'200 CHF	98.50%	2'167'000.00	0.06	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	0	2'000	0	2'000 CHF	99.05%	1'981'000.00	0.06	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	1'500	2'000	0	3'500 CHF	94.50%	3'307'500.00	0.09	a)
CH0398633450	0.8750 % MOBNSW 0 7/8 10/02/23	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	3'000	0	0	3'000 CHF	91.79%	2'753'700.00	0.08	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	10'000	0	3'000	7'000 CHF	96.40%	6'748'000.00	0.19	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	1'250	1'000	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	0	6'100	0	6'100 CHF	99.54%	6'071'940.00	0.17	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	5'880	0	0	5'880 CHF	91.10%	5'356'680.00	0.15	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	4'000	0	1'300	2'700 CHF	93.55%	2'525'850.00	0.07	a)
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	0	400	0	400 CHF	97.90%	391'600.00	0.01	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	10'250	0	5'000	5'250 CHF	97.00%	5'092'500.00	0.15	a)
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	6'690	0	6'690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	0	500	0	500 CHF	95.45%	477'250.00	0.01	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	5'000	0	0	5'000 CHF	99.40%	4'970'000.00	0.14	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	0	5'000	0	5'000 CHF	96.75%	4'837'500.00	0.14	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	5'000	0	0	5'000 CHF	93.55%	4'677'500.00	0.13	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	6'750	7'500	0	14'250 CHF	92.30%	13'152'750.00	0.38	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	3'000	2'000	0	5'000 CHF	86.50%	4'325'000.00	0.12	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	5'500	18'200	0	23'700 CHF	93.35%	22'123'950.00	0.63	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.
CH0419040982	0.5000 % SCMNXX 0 1/2 03/15/29	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	0	1'000	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.03	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	4'000	1'500	0	5'500 CHF	91.75%	5'046'250.00	0.14	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	25'500	0	16'660	8'840 CHF	87.61%	7'744'724.00	0.22	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	5'000	0	0	5'000 CHF	85.05%	4'252'500.00	0.12	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	0	2'000	0	2'000 CHF	91.60%	1'832'000.00	0.05	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	2'890	1'500	4'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	6'000	0	0	6'000 CHF	79.55%	4'773'000.00	0.14	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	6'410	0	0	6'410 CHF	90.10%	5'775'410.00	0.17	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	1'200	0	0	1'200 CHF	92.85%	1'114'200.00	0.03	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	9'000	0	3'000	6'000 CHF	81.65%	4'899'000.00	0.14	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'000	2'000	0	3'000 CHF	85.45%	2'563'500.00	0.07	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	4'000	0	0	4'000 CHF	90.40%	3'616'000.00	0.10	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041519	0.0500 % IRENSW 0.05 10/09/23	500	8'300	8'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	0	15'800	0	15'800 CHF	70.30%	11'107'400.00	0.32	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'800	0	0	3'800 CHF	72.65%	2'760'700.00	0.08	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKKB 0 11/05/29	15'000	0	0	15'000 CHF	89.75%	13'462'500.00	0.38	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	11'250	0	1'600	9'650 CHF	96.40%	9'302'600.00	0.27	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	3'800	7'000	10'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	18'000	0	1'500	16'500 CHF	94.57%	15'604'050.00	0.45	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	600	0	0	600 CHF	99.05%	594'300.00	0.02	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	5'000	0	1'000	4'000 CHF	94.64%	3'785'600.00	0.11	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	11'750	0	5'750	6'000 CHF	95.50%	5'730'000.00	0.16	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'000	0	0	2'000 CHF	98.00%	1'960'000.00	0.06	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0437180935	0.7500 % SCMNXX 0 3/4 10/12/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	17'300	3'200	7'300	13'200 CHF	85.95%	11'345'400.00	0.32	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	20'000	0	5'000	15'000 CHF	88.65%	13'297'500.00	0.38	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	22'875	10'000	17'000	15'875 CHF	82.90%	13'160'375.00	0.38	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	32'500	1'500	31'000 CHF	104.86%	32'506'600.00	0.93	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	0	1'000	0	1'000 CHF	88.90%	889'000.00	0.03	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	7'250	0	0	7'250 CHF	88.85%	6'441'625.00	0.18	a)
CH0457206800	0.3000 % ABBNXX 0.3 08/06/24	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206818	1.0000 % ABBNXX 1 05/07/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	3'000	0	0	3'000 CHF	99.23%	2'976'810.00	0.09	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	3'000	0	0	3'000 CHF	80.90%	2'427'000.00	0.07	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	13'250	0	0	13'250 CHF	97.25%	12'885'625.00	0.37	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	11'000	1'000	0	12'000 CHF	80.25%	9'630'000.00	0.28	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	1'000	0	0	1'000 CHF	88.35%	883'500.00	0.03	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	15'500	1'000	16'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	5'000	0	0	5'000 CHF	94.90%	4'745'000.00	0.14	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	6'450	0	450	6'000 CHF	91.60%	5'496'000.00	0.16	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	0	1'200	0	1'200 CHF	99.02%	1'188'240.00	0.03	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	0	6'500	0	6'500 CHF	92.25%	5'996'250.00	0.17	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	6'850	1'000	0	7'850 CHF	96.60%	7'583'100.00	0.22	a)
CH0479514306	0.0200 % KNINSW 0.02 11/18/22	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	6'000	0	0	6'000 CHF	89.65%	5'379'000.00	0.15	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	4'400	0	0	4'400 CHF	89.64%	3'944'160.00	0.11	a)
CH0483181001	0.0000 % CS 0 07/16/29 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	89.00%	2'047'000.00	0.06	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	13'700	0	11'700	2'000 CHF	94.62%	1'892'400.00	0.05	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	3'200	8'000	3'400	7'800 CHF	85.20%	6'645'600.00	0.19	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	0	3'000	0	3'000 CHF	77.40%	2'322'000.00	0.07	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	500	17'310	4'500	13'310 CHF	62.55%	8'325'405.00	0.24	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	2'500	0	0	2'500 CHF	90.50%	2'262'500.00	0.06	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	2'575	0	0	2'575 CHF	93.90%	2'417'925.00	0.07	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	0	1'500	0	1'500 CHF	58.75%	881'250.00	0.03	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	4'000	0	0	4'000 CHF	89.65%	3'586'000.00	0.10	a)
CH0498400586	0.1000 % CAABNK 0.1 10/23/23	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393348	0.0000 % PSHYPO 0 08/16/23 679	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	22'250	775	22'250	775 CHF	96.37%	746'867.50	0.02	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	17'885	0	1'000	16'885 CHF	93.80%	15'838'130.00	0.45	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	9'000	0	0	9'000 CHF	88.60%	7'974'000.00	0.23	a)
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	10'000	1'000	11'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'400	0	0	2'400 CHF	74.55%	1'789'200.00	0.05	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	92.55%	4'627'500.00	0.13	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	5'000	2'000	0	7'000 CHF	89.55%	6'268'500.00	0.18	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	10'000	0	5'000	5'000 CHF	80.70%	4'035'000.00	0.12	a)
CH0508785778	0.0000 % SWMOB 2019-1 A	0	2'350	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663581	0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN	7'400	0	0	7'400 CHF	96.60%	7'148'400.00	0.20	a)
CH0520663599	0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN	6'000	3'500	1'000	8'500 CHF	86.25%	7'331'250.00	0.21	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	0	2'800	0	2'800 CHF	83.90%	2'349'200.00	0.07	a)
CH0520663631	0.0000 % SWMOB 2020-1 A	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	0	1'500	0	1'500 CHF	87.85%	1'317'750.00	0.04	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	675	0	0	675 CHF	88.50%	597'375.00	0.02	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	8'500	0	0	8'500 CHF	88.80%	7'548'000.00	0.22	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	0	0	8'000 CHF	95.70%	7'656'000.00	0.22	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	7'750	0	7'750	0 CHF	96.05%	7'443'875.00	0.21	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	11'750	3'250	6'750	8'250 CHF	93.42%	7'707'150.00	0.22	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	2'700	35'250	6'000	31'950 CHF	66.85%	21'358'575.00	0.61	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	0	3'000	0	3'000 CHF	98.97%	2'969'142.00	0.08	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	5'000	0	0	5'000 CHF	99.97%	4'998'500.00	0.14	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	4'400	0	3'400	1'000 CHF	97.10%	971'000.00	0.03	a)
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	400	9'420	0	9'820 CHF	99.81%	9'801'342.00	0.28	a)
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	3'800	4'000	5'000	2'800 CHF	87.40%	2'447'200.00	0.07	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	0	6'000	0	6'000 CHF	73.87%	4'432'200.00	0.13	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	0	2'300	0	2'300 CHF	90.31%	2'077'130.00	0.06	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	0	5'000	2'600	2'400 CHF	82.90%	1'989'600.00	0.06	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	0	2'500	0	2'500 CHF	81.65%	2'041'250.00	0.06	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	0	1'000	0	1'000 CHF	79.45%	794'500.00	0.02	a)
CH0536893602	1.0000 % STMNSW 1 10/03/23	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	500	0	0	500 CHF	80.32%	401'600.00	0.01	a)
CH0538763522	0.7500 % COOPSW 0 3/4 05/05/23	12'300	0	12'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032877	1.0000 % LONNVX 1 04/28/23	16'000	0	16'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	7'500	0	2'500	5'000 CHF	93.60%	4'680'000.00	0.13	a)
CH0539032943	1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	3'750	0	3'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	5'000	0	0	5'000 CHF	91.40%	4'570'000.00	0.13	a)
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	130	1'000	1'130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'500	0	0	1'500 CHF	85.90%	1'288'500.00	0.04	a)
CH0545766575	0.6250 % SWICC 2020-1 A	0	3'925	3'925	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	3'140	0	0	3'140 CHF	97.70%	3'067'780.00	0.09	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN	3'000	1'500	0	4'500 CHF	92.15%	4'146'750.00	0.12	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	0	2'300	0	2'300 CHF	74.20%	1'706'600.00	0.05	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	3'565	0	0	3'565 CHF	97.65%	3'481'222.50	0.10	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'000	0	0	3'000 CHF	97.35%	2'920'500.00	0.08	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	20'000	7'000	10'000	17'000 CHF	90.04%	15'306'800.00	0.44	a)
CH0557778658	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 DEC	0	30'000	30'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778666	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 0001	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778690	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 JAN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	7'000	0	1'800	5'200 CHF	75.30%	3'915'600.00	0.11	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	6'000	0	0	6'000 CHF	90.35%	5'421'000.00	0.16	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	5'000	0	0	5'000 CHF	76.65%	3'832'500.00	0.11	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	0	9'500	2'500	7'000 CHF	87.25%	6'107'500.00	0.17	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	32'750	0	0	32'750 CHF	90.12%	29'514'300.00	0.84	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	6'000	0	800	5'200 CHF	70.50%	3'666'000.00	0.10	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	8'300	2'000	0	10'300 CHF	85.04%	8'759'120.00	0.25	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	12'000	0	5'000	7'000 CHF	91.75%	6'422'500.00	0.18	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	40'600	0	16'600	24'000 CHF	90.85%	21'804'000.00	0.62	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	12'750	0	0	12'750 CHF	90.15%	11'494'125.00	0.33	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	500	0	0	500 CHF	92.20%	461'000.00	0.01	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	0	1'800	0	1'800 CHF	96.88%	1'743'840.00	0.05	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	24'300	0	0	24'300 CHF	92.01%	22'358'430.00	0.64	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	25'000	0	5'000	20'000 CHF	79.71%	15'942'000.00	0.46	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	82.70%	4'135'000.00	0.12	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	5'000	5'300	5'300	5'000 CHF	94.65%	4'732'500.00	0.14	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	0	6'000	0	6'000 CHF	72.45%	4'347'000.00	0.12	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	4'000	1'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	20'000	0	10'000	10'000 CHF	89.19%	8'919'000.00	0.26	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	28'250	0	8'250	20'000 CHF	93.40%	18'680'000.00	0.53	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	6'500	0	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	6'000	0	0	6'000 CHF	90.05%	5'403'000.00	0.15	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	9'500	0	0	9'500 CHF	82.90%	7'875'500.00	0.23	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	86.00%	3'440'000.00	0.10	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	5'000	1'600	0	6'600 CHF	88.55%	5'844'300.00	0.17	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVS 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	85.70%	3'428'000.00	0.10	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	5'000	0	0	5'000 CHF	87.85%	4'392'500.00	0.13	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	5'450	0	0	5'450 CHF	89.90%	4'899'550.00	0.14	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	29'000	0	0	29'000 CHF	87.05%	25'244'500.00	0.72	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	0	1'650	0	1'650 CHF	97.15%	1'602'975.00	0.05	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	6'250	0	0	6'250 CHF	91.75%	5'734'375.00	0.16	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	0	1'500	500	1'000 CHF	87.30%	873'000.00	0.02	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	0	1'500	0	1'500 CHF	88.55%	1'328'250.00	0.04	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSW 0 1/8 09/15/33	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	2'250	0	0	2'250 CHF	88.70%	1'995'750.00	0.06	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	14'000	0	7'000	7'000 CHF	87.69%	6'138'300.00	0.18	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'600	0	0	2'600 CHF	79.20%	2'059'200.00	0.06	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'140	0	0	1'140 CHF	96.20%	1'096'680.00	0.03	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	20'000	0	10'000	10'000 CHF	87.75%	8'775'000.00	0.25	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	7'000	6'000	0	13'000 CHF	82.12%	10'675'600.00	0.31	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'650	0	0	1'650 CHF	96.40%	1'590'600.00	0.05	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	3'000	0	0	3'000 CHF	70.05%	2'101'500.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	13'000	0	5'000	8'000 CHF	82.45%	6'596'000.00	0.19	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	6'700	0	0	6'700 CHF	96.97%	6'496'990.00	0.19	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	4'300	0	0	4'300 CHF	65.25%	2'805'750.00	0.08	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	33'500	0	0	33'500 CHF	88.70%	29'714'500.00	0.85	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	16'400	0	800	15'600 CHF	91.05%	14'203'800.00	0.41	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	13'000	0	0	13'000 CHF	88.79%	11'542'700.00	0.33	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	500	0	0	500 CHF	90.15%	450'750.00	0.01	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	5'500	3'500	0	9'000 CHF	86.60%	7'794'000.00	0.22	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	10'700	0	1'000	9'700 CHF	88.55%	8'589'350.00	0.25	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	5'000	0	0	5'000 CHF	79.23%	3'961'500.00	0.11	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	13'050	0	3'050	10'000 CHF	95.69%	9'569'000.00	0.27	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	500	10'000	1'000	9'500 CHF	86.80%	8'246'000.00	0.24	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	14'950	0	14'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	2'650	0	0	2'650 CHF	97.90%	2'594'350.00	0.07	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	500	0	0	500 CHF	88.40%	442'000.00	0.01	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'800	0	0	6'800 CHF	71.65%	4'872'200.00	0.14	a)
CH1167887285	0.0000 % ABBNVX 0 09/25/23	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	20'000	0	11'000	9'000 CHF	94.15%	8'473'500.00	0.24	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	5'500	0	3'000	2'500 CHF	94.18%	2'354'500.00	0.07	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	8'000	0	0	8'000 CHF	92.54%	7'403'200.00	0.21	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	7'500	0	0	7'500 CHF	89.50%	6'712'500.00	0.19	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	9'120	0	2'400	6'720 CHF	93.60%	6'289'920.00	0.18	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	5'000	2'500	2'500 CHF	95.45%	2'386'250.00	0.07	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	23'400	0	3'400	20'000 CHF	98.04%	19'608'000.00	0.56	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	10'000	0	2'500	7'500 CHF	97.35%	7'301'250.00	0.21	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	3'500	0	3'000	500 CHF	93.72%	468'600.00	0.01	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	11'300	0	0	11'300 CHF	84.46%	9'543'980.00	0.27	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'875	0	0	1'875 CHF	95.55%	1'791'562.50	0.05	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	5'000	0	0	5'000 CHF	94.10%	4'705'000.00	0.13	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	5'300	0	0	5'300 CHF	98.00%	5'194'000.00	0.15	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	0	7'400	0	7'400 CHF	97.45%	7'211'300.00	0.21	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	15'750	0	800	14'950 CHF	97.50%	14'576'250.00	0.42	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	0	1'500	0	1'500 CHF	98.40%	1'476'000.00	0.04	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	4'500	0	0	4'500 CHF	98.40%	4'428'000.00	0.13	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	9'500	0	0	9'500 CHF	99.28%	9'431'600.00	0.27	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	24'500	3'000	2'000	25'500 CHF	100.77%	25'696'350.00	0.73	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	30'000	0	1'000	29'000 CHF	98.82%	28'657'800.00	0.82	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	12'000	0	0	12'000 CHF	99.20%	11'904'000.00	0.34	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	14'000	2'300	0	16'300 CHF	100.10%	16'316'300.00	0.47	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	10'000	0	0	10'000 CHF	98.60%	9'860'000.00	0.28	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	4'250	0	600	3'650 CHF	98.50%	3'595'250.00	0.10	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	14'600	0	0	14'600 CHF	97.70%	14'264'200.00	0.41	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	0	0	2'500 CHF	97.70%	2'442'500.00	0.07	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	10'000	0	0	10'000 CHF	100.80%	10'080'000.00	0.29	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	5'100	0	0	5'100 CHF	100.35%	5'117'850.00	0.15	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	13'900	1'000	12'900 CHF	102.55%	13'228'950.00	0.38	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	5'000	0	0	5'000 CHF	106.47%	5'323'500.00	0.15	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	700	10'000	0	10'700 CHF	109.67%	11'734'690.00	0.34	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	105.65%	2'641'250.00	0.08	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	7'370	0	0	7'370 CHF	104.55%	7'705'335.00	0.22	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	5'000	4'700	0	9'700 CHF	100.30%	9'729'100.00	0.28	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'500	0	0	1'500 CHF	98.65%	1'479'750.00	0.04	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	4'000	0	0	4'000 CHF	99.90%	3'996'000.00	0.11	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.
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	0	10'000 CHF	99.47%	9'947'000.00	0.28 a)	
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	0	10'000	0	10'000 CHF	104.04%	10'404'000.00	0.30 a)	
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	5'000	0	0	5'000 CHF	100.05%	5'002'500.00	0.14 a)	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	0	1'000	0	1'000 CHF	106.85%	1'068'500.00	0.03 a)	
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	0	6'800	0	6'800 CHF	107.60%	7'316'800.00	0.21 a)	
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	0	6'000	0	6'000 CHF	100.45%	6'027'000.00	0.17 a)	
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	16'000	0	0	16'000 CHF	97.60%	15'616'000.00	0.45 a)	
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	2'750	0	0	2'750 CHF	99.75%	2'743'125.00	0.08 a)	
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	5'000	0	300	4'700 CHF	100.15%	4'707'050.00	0.13 a)	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	2'500	0	0	2'500 CHF	102.15%	2'553'750.00	0.07 a)	
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	108.15%	5'407'500.00	0.15 a)	
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.14 a)	
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	3'000	0	0	3'000 CHF	103.30%	3'099'000.00	0.09 a)	
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	0	21'000	3'500	17'500 CHF	105.55%	18'471'250.00	0.53 a)	
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	0	3'500	0	3'500 CHF	103.50%	3'622'500.00	0.10 a)	
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	0	2'000	0	2'000 CHF	101.45%	2'029'000.00	0.06 a)	
CH1230759511	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 DEC	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759529	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 DEC	0	16'000	16'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	0	26'300	5'000	21'300 CHF	102.50%	21'832'500.00	0.62 a)	
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	0	5'000	0	5'000 CHF	100.90%	5'045'000.00	0.14 a)	
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	0	12'000	0	12'000 CHF	101.90%	12'228'000.00	0.35 a)	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	0	13'500	8'500	5'000 CHF	99.88%	4'994'000.00	0.14 a)	
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	0	10'000	3'000	7'000 CHF	100.21%	7'014'700.00	0.20 a)	
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	0	11'000	850	10'150 CHF	99.99%	10'148'985.00	0.29 a)	
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	0	5'000	0	5'000 CHF	103.60%	5'180'000.00	0.15 a)	
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	2'200	0	2'200 CHF	103.30%	2'272'600.00	0.06 a)	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	10'000	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.29 a)	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	3'500	500	3'000 CHF	102.20%	3'066'000.00	0.09 a)	
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	21'460	6'000	15'460 CHF	103.10%	15'939'260.00	0.46 a)	
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	5'250	0	5'250 CHF	102.00%	5'355'000.00	0.15 a)	
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	0	13'000	1'000	12'000 CHF	101.30%	12'156'000.00	0.35 a)	
CH1239495000	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 JAN	0	4'700	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	0	6'500	0	6'500 CHF	100.60%	6'539'000.00	0.19 a)	
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	0	2'500	0	2'500 CHF	102.00%	2'550'000.00	0.07 a)	
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	0	3'850	0	3'850 CHF	104.10%	4'007'850.00	0.11 a)	
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	0	4'500	0	4'500 CHF	100.20%	4'509'000.00	0.13 a)	
CH1243651945	2.7500 % KWLILJ 2 3/4 03/01/30	0	2'550	0	2'550 CHF	103.30%	2'634'150.00	0.08 a)	
CH1249415998	2.4586 % CS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.39%	3'011'700.00	0.09 a)	
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	0	5'500	0	5'500 CHF	103.03%	5'666'650.00	0.16 a)	
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	8'500	0	8'500 CHF	103.10%	8'763'500.00	0.25 a)	
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	1'500	0	1'500 CHF	100.70%	1'510'500.00	0.04 a)	
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	0	3'000	0	3'000 CHF	104.30%	3'129'000.00	0.09 a)	
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	5'140	0	5'140 CHF	100.40%	5'160'560.00	0.15 a)	
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	0	5'000	0	5'000 CHF	99.98%	4'999'000.00	0.14 a)	
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	4'000	0	4'000 CHF	101.25%	4'050'000.00	0.12 a)	
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	32'500	0	32'500 CHF	102.65%	33'361'250.00	0.95 a)	
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	3'000	200	2'800 CHF	101.10%	2'830'800.00	0.08 a)	
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	4'650	0	4'650 CHF	118.45%	5'507'925.00	0.16 a)	
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	3'550	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	11'500	700	10'800 CHF	101.60%	10'972'800.00	0.31 a)	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	6'000	0	6'000 CHF	101.20%	6'072'000.00	0.17 a)	
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	6'250	2'200	4'050 CHF	101.17%	4'097'385.00	0.12 a)	
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	850	0	850 CHF	100.82%	856'970.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	3'500	0	3'500 CHF	101.25%	3'543'750.00	0.10	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	0	6'470	0	6'470 CHF	100.95%	6'531'465.00	0.19	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	2'770	0	2'770 CHF	100.15%	2'774'155.00	0.08	a)
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	7'400	7'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	1'250	0	1'250 CHF	102.60%	1'282'500.00	0.04	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	6'300	0	6'300 CHF	100.91%	6'357'330.00	0.18	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	13'000	1'300	11'700 CHF	98.71%	11'549'070.00	0.33	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	3'000	0	3'000 CHF	101.10%	3'033'000.00	0.09	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	0	21'000	0	21'000 CHF	99.65%	20'926'500.00	0.60	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	4'000	0	4'000 CHF	100.65%	4'026'000.00	0.12	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.14	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	6'000	0	6'000 CHF	102.82%	6'169'440.00	0.18	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	4'500	0	4'500 CHF	101.40%	4'563'000.00	0.13	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	3'500	0	3'500 CHF	102.35%	3'582'250.00	0.10	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	6'375	0	6'375 CHF	100.55%	6'409'808.14	0.18	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	3'850	0	3'850 CHF	101.25%	3'898'163.50	0.11	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	7'500	0	7'500 CHF	100.55%	7'541'250.00	0.22	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	0	5'000	0	5'000 CHF	100.65%	5'032'500.00	0.14	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.05%	5'052'500.00	0.14	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	5'000	0	5'000 CHF	100.50%	5'025'000.00	0.14	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	5'000	0	5'000 CHF	100.85%	5'042'500.00	0.14	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43	0	10'000	0	10'000 CHF	99.79%	9'978'500.00	0.29	a)
CH							2'491'887'612.44	71.26	
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	93.75%	1'875'000.00	0.05	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.03	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	9'000	0	3'000	6'000 CHF	97.78%	5'866'800.00	0.17	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	87.25%	1'745'000.00	0.05	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	95.30%	953'000.00	0.03	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	91.95%	1'379'250.00	0.04	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	92.75%	5'565'000.00	0.16	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	2'000	4'600	0	6'600 CHF	93.00%	6'138'000.00	0.18	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	93.45%	7'476'000.00	0.21	a)
CL							31'980'550.00	0.91	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	5'100	5'450	0	10'550 CHF	99.72%	10'520'460.00	0.30	a)
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	0	7'500	800	6'700 CHF	92.30%	6'184'100.00	0.18	a)
CH0399198396	0.6250 % DB 0 5/8 02/08/23 EMTN	3'100	0	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	95.20%	1'237'600.00	0.04	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	2'530	0	0	2'530 CHF	95.30%	2'411'090.00	0.07	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.90%	1'818'000.00	0.05	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	10'000	0	600	9'400 CHF	92.50%	8'695'000.00	0.25	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	12'000	0	4'000	8'000 CHF	86.60%	6'928'000.00	0.20	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	13'000	0	0	13'000 CHF	90.70%	11'791'000.00	0.34	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	90.50%	8'507'000.00	0.24	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	4'250	6'500	0	10'750 CHF	76.05%	8'175'375.00	0.23	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	5'800	1'200	800	6'200 CHF	92.60%	5'741'200.00	0.16	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	89.20%	6'690'000.00	0.19	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.30%	10'130'000.00	0.29	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.14	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.30%	5'015'000.00	0.14	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.05%	4'042'000.00	0.12	a)
DE							102'933'325.00	2.94	
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	110.15%	1'652'250.00	0.05	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.45%	10'145'000.00	0.29	a)
DK							11'797'250.00	0.34	
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	720	0	720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	9'340	0	9'340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'000	300	0	1'300 CHF	98.80%	1'284'400.00	0.04	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	7'000	0	4'500	2'500 CHF	92.60%	2'315'000.00	0.07	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	10'000	1'000	8'600	2'400 CHF	94.60%	2'270'400.00	0.06	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	6'000	3'900	0	9'900 CHF	91.80%	9'088'200.00	0.26	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	93.45%	2'616'600.00	0.07	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	100.50%	7'035'000.00	0.20	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.90%	5'045'000.00	0.14	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	9'500	0	9'500 CHF	102.80%	9'766'000.00	0.28	a)
ES							39'420'600.00	1.13	
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	98.85%	4'942'500.00	0.14	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.29	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	11'000	0	11'000 CHF	101.15%	11'126'500.00	0.32	a)
FI							26'209'000.00	0.75	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	12'025	1'500	0	13'525 CHF	102.05%	13'802'262.50	0.39	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	5'000	14'440	10'000	9'440 CHF	100.09%	9'448'496.00	0.27	a)
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	0	10'000	800	9'200 CHF	100.00%	9'200'000.00	0.26	a)
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	5'000	2'300	7'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	97.97%	4'898'500.00	0.14	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	13'000	0	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	7'500	1'000	6'000	2'500 CHF	98.53%	2'463'250.00	0.07	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	94.60%	1'892'000.00	0.05	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	99.50%	3'980'000.00	0.11	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	91.80%	6'426'000.00	0.18	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	5'200	0	2'600	2'600 CHF	93.25%	2'424'500.00	0.07	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	90.50%	2'715'000.00	0.08	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	4'800	0	0	4'800 CHF	91.30%	4'382'400.00	0.13	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	90.30%	2'709'000.00	0.08	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	10'000	0	2'000	8'000 CHF	93.10%	7'448'000.00	0.21	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	7'600	2'000	800	8'800 CHF	92.95%	8'179'600.00	0.23	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	5'400	0	0	5'400 CHF	102.30%	5'524'200.00	0.16	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	10'500	0	0	10'500 CHF	91.75%	9'633'750.00	0.28	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	90.85%	2'725'500.00	0.08	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	8'260	0	7'000	1'260 CHF	94.25%	1'187'550.00	0.03	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	1'400	2'600	0	4'000 CHF	91.30%	3'652'000.00	0.10	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	95.85%	8'626'500.00	0.25	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	0	3'800	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	0	7'500	3'000	4'500 CHF	100.85%	4'538'250.00	0.13	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	100.70%	3'826'600.00	0.11	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.50%	10'250'000.00	0.29	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	100.30%	6'018'000.00	0.17	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	100.85%	2'521'250.00	0.07	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.95%	10'195'000.00	0.29	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.20%	10'220'000.00	0.29	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.00%	5'100'000.00	0.15	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.70%	10'270'000.00	0.29	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.14	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.55%	5'077'500.00	0.15	a)
FR							184'382'608.50	5.27	
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	5'175	0	5'175	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	6'150	0	0	6'150 CHF	97.05%	5'968'575.00	0.17	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	93.50%	11'220'000.00	0.32	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	16'000	1'200	1'000	16'200 CHF	92.65%	15'009'300.00	0.43	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	7'600	0	2'600	5'000 CHF	91.05%	4'552'500.00	0.13	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	98.75%	1'580'000.00	0.05	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	9'000	0	5'000	4'000 CHF	97.75%	3'910'000.00	0.11	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.65%	2'013'000.00	0.06	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	101.45%	2'637'700.00	0.08	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.00%	3'030'000.00	0.09	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.15%	4'046'000.00	0.12	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.80%	5'090'000.00	0.15	a)
GB							59'057'075.00	1.69	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	3'400	5'000	0	8'400 CHF	98.05%	8'236'200.00	0.24	a)
IE							8'236'200.00	0.24	
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
JE							0.00	0.00	
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'000	3'000	3'000	3'000 CHF	99.25%	2'977'500.00	0.09	a)
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.91%	1'978'200.00	0.06	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	97.92%	2'937'600.00	0.08	a)
CH0465767793	0.0000 % KORGAS 0 11/28/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	0	2'500	0	2'500 CHF	96.90%	2'422'500.00	0.07	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0551990713	0.7525 % HYUCAP 0.7525 07/06/23 GMTN	8'200	0	8'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	17'000	0	0	17'000 CHF	97.15%	16'515'500.00	0.47	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	5'000	0	0	5'000 CHF	100.60%	5'030'000.00	0.14	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROIL 2.15 12/19/24	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	4'545	0	4'545 CHF	100.65%	4'574'542.50	0.13	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	155	155	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	5'000	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.14	a)
KR							41'483'342.50	1.19	
CH0391648026	0.3750 % ADCBUH 0 3/8 01/23/23 GMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	4'600	0	0	4'600 CHF	97.86%	4'501'560.00	0.13	a)
KY							4'501'560.00	0.13	
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	7'140	0	7'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'500	0	0	1'500 CHF	87.80%	1'317'000.00	0.04	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	104.55%	2'091'000.00	0.06	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 CHF	101.60%	3'048'000.00	0.09	a)
LI							6'456'000.00	0.18	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	5'000	0	4'000	1'000 CHF	99.84%	998'400.00	0.03	a)
LU							998'400.00	0.03	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	5'350	0	0	5'350 CHF	103.60%	5'542'600.00	0.16	a)
CH0033037679	3.5000 % RABOBK 3 1/2 08/31/23 EMTN	0	2'650	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.75%	2'075'000.00	0.06	a)
CH0136594337	1.6250 % EBN 1 5/8 10/03/23 EMTN	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	2'750	5'000	0	7'750 CHF	98.55%	7'637'625.00	0.22	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	74.40%	3'720'000.00	0.11	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	10'000	0	0	10'000 CHF	93.20%	9'320'000.00	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.
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	2'725	0	2'725 CHF	100.70%	2'744'075.00	0.08 a)	
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.85%	5'092'500.00	0.15 a)	
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.50%	5'025'000.00	0.14 a)	
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	100.45%	4'017'999.60	0.11 a)	
NL							45'174'799.60	1.29	
CH0318407761	0.3500 % MINGNO 0.35 04/05/23 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	2'000	5'000	0	7'000 CHF	99.29%	6'950'300.00	0.20 a)	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	7'500	800	0	8'300 CHF	97.35%	8'080'050.00	0.23 a)	
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.55%	4'977'500.00	0.14 a)	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	8'600	0	8'600 CHF	100.90%	8'677'400.00	0.25 a)	
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.15%	5'107'500.00	0.15 a)	
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.10%	4'044'000.00	0.12 a)	
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.75%	5'037'500.00	0.14 a)	
NO							42'874'250.00	1.23	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	400	2'160	2'560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451825	0.2500 % ANZLN 0 1/4 10/25/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZLN 0.35 10/22/24 EMTN	4'750	0	2'750	2'000 CHF	98.33%	1'966'600.00	0.06 a)	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	90.95%	2'728'500.00	0.08 a)	
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	3'950	0	0	3'950 CHF	91.40%	3'610'300.00	0.10 a)	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	4'200	0	3'750	450 CHF	91.15%	410'175.00	0.01 a)	
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	3'750	0	3'750 CHF	101.85%	3'819'375.00	0.11 a)	
NZ							12'534'950.00	0.36	
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	0	570	570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	6'500	0	0	6'500 CHF	92.55%	6'015'750.00	0.17 a)	
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	0	1'000	0	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.03 a)	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	100.00%	4'000'000.00	0.11 a)	
SE							10'976'750.00	0.31	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	16'350	0	16'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	6'610	1'400	0	8'010 CHF	98.43%	7'884'243.00	0.23 a)	
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	16'000	0	16'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	8'500	1'500	2'000	8'000 CHF	96.90%	7'752'000.00	0.22 a)	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	13'500	0	5'500	8'000 CHF	95.50%	7'640'000.00	0.22 a)	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	5'000	0	3'750	1'250 CHF	93.45%	1'168'125.00	0.03 a)	
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	7'500	2'000	700	8'800 CHF	92.05%	8'100'400.00	0.23 a)	
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	10'000	2'000	2'000	10'000 CHF	88.00%	8'800'000.00	0.25 a)	
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	90.80%	2'724'000.00	0.08 a)	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	5'000	1'500	0	6'500 CHF	89.00%	5'785'000.00	0.17 a)	
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	89.75%	1'077'000.00	0.03 a)	
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	1'700	1'700	0	3'400 CHF	90.00%	3'060'000.00	0.09 a)	
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	4'900	4'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
US							53'990'768.00	1.54	
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	3'600	4'000	1'000	6'600 CHF	103.65%	6'840'900.00	0.20 a)	
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	0	4'000	0	4'000 CHF	93.85%	3'754'000.00	0.11	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	0	2'000	0	2'000 CHF	94.55%	1'891'000.00	0.05	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	3'050	0	0	3'050 CHF	99.13%	3'023'465.00	0.09	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	6'000	0	0	6'000 CHF	93.50%	5'610'000.00	0.16	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	4'015	0	0	4'015 CHF	97.30%	3'906'595.00	0.11	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	0	1'500	0	1'500 CHF	93.65%	1'404'750.00	0.04	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	84.15%	841'500.00	0.02	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	0	1'200	0	1'200 CHF	89.50%	1'074'000.00	0.03	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	90.05%	4'502'500.00	0.13	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	87.70%	6'139'000.00	0.18	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'000	200	0	3'200 CHF	94.25%	3'016'000.00	0.09	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.25%	5'012'500.00	0.14	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	4'000	0	4'000 CHF	101.25%	4'050'000.00	0.12	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.85%	5'092'500.00	0.15	a)

XS

56'158'710.00 1.61

Derivative Finanzinstrumente

-1'410'848.75 -0.04

Swaps

-1'410'848.75 -0.04

01/31	IRS FIX LEG 0.1% P.A. CHF	-30'000	30'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/31	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	30'000	0	30'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
02/32	IRS FIX LEG 1.725% P.A. CHF	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
02/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/32	IRS FIX LEG 1.8375% P.A. CHF	0	0	30'000	-30'000 CHF	102.31%	-30'693'738.30	-0.88	b)
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	30'000	0	30'000 CHF	100.00	30'000'000.00	0.86	b)
08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	0	0	15'000	-15'000 CHF	102.46%	-15'369'128.25	-0.44	b)
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	0.43	b)
02/33	IRS FIX LEG 1.8225% P.A. CHF	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
02/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	25'000	25'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	0	0	20'000	-20'000 CHF	101.74%	-20'347'982.20	-0.58	b)
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	20'000	0	20'000 CHF	100.00	20'000'000.00	0.57	b)
01/49	IRS FIX LEG 1.465% P.A. CHF	-10'000	10'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/49	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	58'286'821.32	1.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'418'399'533.54	97.76
Derivative Finanzinstrumente	-1'410'848.75	-0.04
Sonstige Vermögenswerte	21'564'288.01	0.62
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'496'839'794.12	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-262'228.48	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'496'577'565.64	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	3'418'399'533.54	97.76
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'410'848.75	-0.04
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts

OTC COLLATERAL IV-BFCHFA CHF ZKB	1'200'000 CHF	1'200'000.00
----------------------------------	---------------	--------------

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

USD 1 = CHF 0.91005000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	66'410'848.75	1.899

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	0.750	1.200	0.550	0.200	2.000
CT CHF	0.450	0.750	0.250	0.200	2.000
DT CHF	0.350	0.700	0.250	0.100	2.000
GT CHF	0.280	0.600	0.180	0.100	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

Periode: 27.12.2022 - 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
BA CHF	0.480	0.900	0.280	0.200	2.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

8 Benchmark

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

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.15000	0.05250	0.09750
BA CHF	Nein	CHF	0.35000	0.12250	0.22750

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.39798	0.13929	0.25869
DT CHF	Nein	CHF	5.337	1.867	3.470
GT CHF	Nein	CHF	0.55766	0.19518	0.36248
MT CHF	Nein	CHF	0.78454	0.27458	0.50996
NT CHF	Nein	CHF	11.747	4.111	7.636

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken.

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

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

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 19 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund I

vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

Zurzeit mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

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

(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 10. November 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund I

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übriger Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

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

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

* * *

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

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

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

Zürich, 22. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich