

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE (EX 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»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
ASTT CHF	43450521	CHF
NTH1 CHF	55982810	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://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	28
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	28
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	28
7	Pauschale Verwaltungskommission	29
8	Benchmark	29
9	TER	29
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	29
11	Fussnoten	30
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	31
13	Pflichtpublikationen	33

# 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
<b>Konsolidiert</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'030'954'228.75	876'857'843.81	946'998'416.45	1'009'160'347.94
<b>Klasse ASTT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		451'127'851.98	501'818'733.87	598'744'671.98	673'680'229.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'456'286.314	5'621'120.954	5'849'323.507	6'490'440.507
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		82.6804	89.2738	102.3614	103.7958
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		82.7548	89.3898	102.2078	103.7958
Thesaurierung je Anteil		1.22	1.17	1.46	1.57
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
<b>Klasse NTH1 CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		579'826'376.77	375'039'109.94	348'253'744.47	335'480'118.27
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'026'874.744	4'416'727.933	3'526'835.063	3'356'704.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		82.5155	84.9133	98.7440	99.9433
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		82.5898	85.0237	98.5959	99.9433
Thesaurierung je Anteil		1.59	1.54	1.85	0.23
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 ASTT CHF	-7.39 %	-14.34 %	-1.52 %	0.38 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 15.09.2020)	-2.21 %	-12.97 %	-1.72 %	0.65 %
Benchmark Hedge	-2.64 %	-	-	-
Benchmark	-7.55 %	-14.97 %	-1.77 %	-0.33 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	0.58 %	0.99 %	0.44 %	0.69 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

### Tracking Differenz

Klasse	
Klasse ASTT CHF	0.16 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 15.09.2020)	0.43 %

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	12'247'812.13	13'782'171.14
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'032'216'769.02	862'036'710.65
Derivative Finanzinstrumente	-2'118'091.97	-5'229'065.47
Sonstige Vermögenswerte	9'198'209.33	6'459'055.18
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'051'544'698.51</b>	<b>877'048'871.50</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-20'410'707.02	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-179'762.74	-191'027.69
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'030'954'228.75</b>	<b>876'857'843.81</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse ASTT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'621'120.954	5'849'323.507
Ausgegebene Anteile		513'512.111	975'722.966
Zurückgenommene Anteile		-678'346.751	-1'203'925.519
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>5'456'286.314</b>	<b>5'621'120.954</b>

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'416'727.933	3'526'835.063
Ausgegebene Anteile		3'515'738.266	1'220'468.929
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	119'672.364
Zurückgenommene Anteile		-905'591.455	-450'248.423
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>7'026'874.744</b>	<b>4'416'727.933</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		876'857'843.81	946'998'416.45
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'922'334.13	-2'236'614.80
Saldo aus dem Anteilverkehr		208'889'312.34	57'197'046.18
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-51'870'593.27	-125'101'004.02
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'030'954'228.75</b>	<b>876'857'843.81</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		177'494.40	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-24'600.90	-60'817.46
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		18'569'836.75	15'209'588.43
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'213'464.54	1'689'903.49
<b>Total Ertrag</b>		<b>20'936'194.79</b>	<b>16'838'674.46</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-179.04
Reglementarische Vergütungen		-2'150'640.79	-2'482'324.38
Sonstige Aufwendungen		0.00	-64.29
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-897'251.97	-969'650.96
<b>Total Aufwand</b>		<b>-3'047'892.76</b>	<b>-3'452'218.67</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>17'888'302.03</b>	<b>13'386'455.79</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-35'065'588.18	-32'568'959.68
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		575'354.14	472'546.98
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-16'601'932.01</b>	<b>-18'709'956.91</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-35'268'661.26	-106'391'047.11
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-51'870'593.27</b>	<b>-125'101'004.02</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse ASTT CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	6'669'944.52	6'581'666.32
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>6'669'944.52</b>	<b>6'581'666.32</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'669'944.52	6'581'666.32
<b>Total</b>	<b>6'669'944.52</b>	<b>6'581'666.32</b>

  

<b>Klasse NTH1 CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	11'218'357.51	6'804'789.47
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>11'218'357.51</b>	<b>6'804'789.47</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'926'425.13	2'381'676.31
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'291'932.38	4'423'113.16
<b>Total</b>	<b>11'218'357.51</b>	<b>6'804'789.47</b>

# 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'032'216'769.02</b>	<b>98.16</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'032'216'769.02</b>	<b>98.16</b>	
AU3CB0250512	4.7500 % EBIUH 4 3/4 02/09/28 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	96.11%	553'778.29	0.05	a)
XS1716831570	3.2500 % EBIUH 3 1/4 11/14/22	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2231705950	4.0500 % EBIUH 4.05 09/24/25 EMTN	0	14'690	0	14'690 CNY	100.20%	1'824'527.66	0.17	a)
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	23'000	0	0	23'000 CNY	98.48%	2'807'440.61	0.27	a)
XS2339427820	0.8750 % ETISLT 0 7/8 05/17/33 EMTN	0	4'800	2'300	2'500 EUR	73.40%	1'765'063.37	0.17	a)
XS2339828498	3.5000 % EBIUH 3 1/2 05/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	98.85%	2'450'400.25	0.23	a)
XS2352309681	1.6390 % EMDEBK 1.639 06/15/26 EMTN	400	0	0	400 USD	89.53%	325'898.04	0.03	a)
XS2357280101	3.6700 % EBIUH 3.67 07/13/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	97.55%	1'209'086.57	0.11	a)
XS2466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	3'050	0	1'250	1'800 EUR	90.92%	1'574'302.72	0.15	a)
XS2580013386	4.3750 % FABUH 4 3/8 04/24/28 EMTN	0	7'500	7'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2623206187	5.0840 % MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS	0	4'500	1'500	3'000 USD	83.46%	2'278'662.58	0.22	a)
XS2651619285	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN	0	4'550	3'550	1'000 USD	91.22%	830'125.40	0.08	a)
XS2677030194	5.5000 % ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN	0	3'000	0	3'000 USD	97.59%	2'664'289.28	0.25	a)
XS2707149600	5.8750 % MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS	0	6'950	0	6'950 USD	98.95%	6'258'173.36	0.60	a)
<b>AE</b>							<b>24'541'748.13</b>	<b>2.33</b>	
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	0	3'000	0	3'000 EUR	91.62%	2'643'951.76	0.25	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	1'000	2'000	0	3'000 EUR	90.50%	2'611'631.02	0.25	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	0	1'800	0	1'800 EUR	59.92%	1'037'495.67	0.10	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	0	2'500	0	2'500 EUR	81.89%	1'969'304.46	0.19	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	2'000	5'000	0	7'000 EUR	53.79%	3'621'942.64	0.34	a)
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	2'000	0	400	1'600 EUR	82.72%	1'273'067.68	0.12	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	2'500	3'700	6'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	1'800	0	800	1'000 EUR	68.81%	661'901.77	0.06	a)
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	0	2'900	2'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A32HA3	4.0000 % HYNOC 4 02/01/27 EMTN	0	5'000	1'800	3'200 EUR	98.22%	3'023'435.69	0.29	a)
XS0542825160	3.3750 % ASFING 3 3/8 09/22/25 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2024602240	0.1000 % ASFING 0.1 07/09/29	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2418392143	2.3750 % UQA 2 3/8 12/09/41	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>AT</b>							<b>16'842'730.69</b>	<b>1.60</b>	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	0	3'900	0	3'900 AUD	87.64%	1'969'399.79	0.19	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	2'500	3'000	0	5'500 AUD	71.30%	2'259'402.63	0.21	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	4'000	2'000	0	6'000 AUD	48.61%	1'680'643.27	0.16	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	0	1'000	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	1'000	2'000	3'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	2'800	700	0	3'500 AUD	80.27%	1'618'719.25	0.15	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	0	3'900	0	3'900 AUD	79.30%	1'782'008.05	0.17	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	0	4'200	4'200	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	450	3'550	0	4'000 AUD	68.95%	1'589'200.62	0.15	a)
AU3CB0276509	1.0000 % NBNAUS 1 12/03/25 MTN	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	1'300	0	0	1'300 AUD	68.34%	511'920.95	0.05	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	69.07%	795'925.57	0.08	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	3'800	1'200	600	4'400 CAD	84.86%	2'447'757.82	0.23	a)
JP503604AJ75	0.3200 % WSTP 0.32 07/06/23 12	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	400'000	0	0	400'000 JPY	99.97%	2'402'946.94	0.23	a)
US05253JAX90	5.3750 % ANZ 5 3/8 07/03/25	0	1'350	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05254JAA88	5.0880 % ANZ 5.088 12/08/25	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20271BAJ44	3.2140 % CBAAU 3.214 05/27/25 REGS	3'500	0	260	3'240 USD	96.38%	2'841'765.08	0.27	a)
US20271RAQ39	5.0790 % CBAAU 5.079 01/10/25	0	2'950	2'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US2027A1JZ13	3.9000 % CBAAU 3.9 03/16/28 REGS	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US55608JBL17	6.2070 % MQGAU 6.207 11/22/24 144A	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55608KAL98	4.1500 % MQGAU 4.15 03/27/24 REGS	2'150	0	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55608KAR68	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	89.54%	1'059'316.40	0.10	a)
US55608RBM16	5.2080 % MQGAU 5.208 06/15/26 REGS	0	3'250	1'250	2'000 USD	98.50%	1'792'743.90	0.17	a)
US62878U2F87	5.7500 % NBNAUS 5 3/4 10/06/28 144A	0	1'200	0	1'200 USD	99.84%	1'090'349.73	0.10	a)
US62878V2A72	1.4500 % NBNAUS 1.45 05/05/26 REGS	1'800	0	0	1'800 USD	90.06%	1'475'313.00	0.14	a)
US62878V2D12	1.6250 % NBNAUS 1 5/8 01/08/27 REGS	3'200	0	2'200	1'000 USD	88.12%	801'945.16	0.08	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	1'500	0	0	1'500 USD	83.55%	1'140'514.62	0.11	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	800	0	0	800 USD	95.31%	693'894.92	0.07	a)
USQ66511AB43	5.7500 % NCMAU 5 3/4 11/15/41 REGS	2'200	2'000	1'690	2'510 USD	90.16%	2'059'434.87	0.20	a)
XS1963355364	2.5600 % TOYOTA 2.56 09/28/23 EMTN	1'930	0	1'930	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2187427690	3.5000 % MQGAU 3 1/2 06/24/27 EMTN	0	30'000	0	30'000 CNY	97.10%	3'610'563.60	0.34	a)
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	1'000	0	0	1'000 EUR	89.21%	858'105.96	0.08	a)
XS2463935754	3.6200 % NAB 3.62 04/01/25 GMTN	0	6'000	0	6'000 CNY	100.36%	746'379.73	0.07	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	0	3'000	2'000	1'000 EUR	99.01%	952'442.11	0.09	a)
XS2613209670	4.3750 % SYDAU 4 3/8 05/03/33 EMTN	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>AU</b>							<b>36'180'693.97</b>	<b>3.44</b>	
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6316405560	1.2500 % EUROCL 1 1/4 09/30/24 EMTN	1'400	0	1'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
<b>BE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2579483319	4.5000 % BGARIA 4 1/2 01/27/33 REGS	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>BG</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	89.76%	816'865.27	0.08	a)
<b>BM</b>							<b>816'865.27</b>	<b>0.08</b>	
CA06415EV939	2.1600 % BNS 2.16 02/03/25	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	1'500	0	0	1'500 CAD	69.71%	685'431.45	0.07	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	1'050	0	0	1'050 CAD	77.36%	532'459.39	0.05	a)
CA135087G997	0.5000 % CANRRB 0 1/2 12/01/50 CPI	1'500	0	0	1'500 CAD	81.35%	799'963.49	0.08	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	1'500	1'500	0	3'000 CAD	67.97%	1'336'686.95	0.13	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	1'400	3'400	1'800	3'000 CAD	95.42%	1'876'620.46	0.18	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	0	2'500	0	2'500 CAD	62.74%	1'028'145.09	0.10	a)
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	0	2'000	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	1'400	2'600	2'000	2'000 CAD	84.96%	1'113'915.63	0.11	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	3'000	0	1'500	1'500 CAD	90.69%	891'766.41	0.08	a)
CA135087V505	4.2500 % CANRRB 4 1/4 12/01/26 CPI	3'000	0	1'400	1'600 CAD	191.38%	2'007'271.03	0.19	a)
CA135087WV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	1'500	1'500	1'000	2'000 CAD	194.99%	2'556'404.78	0.24	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	0	3'000	1'500	1'500 CAD	99.72%	980'562.90	0.09	a)
CA563469UZ65	3.8000 % MP 3.8 09/05/53	0	3'800	0	3'800 CAD	81.95%	2'041'382.58	0.19	a)
CA564835AL03	3.1810 % MFCCN 3.181 11/22/27	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA642866GK79	2.6000 % NBRNS 2.6 08/14/26	700	0	0	700 CAD	94.57%	433'940.52	0.04	a)
CA68323AAY07	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/43	2'000	0	0	2'000 CAD	81.59%	1'069'686.78	0.10	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	2'000	0	1'000	1'000 CAD	84.31%	552'697.13	0.05	a)
CA780086QC12	2.9490 % RY 2.949 05/01/23 DPNT	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FA338	1.8880 % TD 1.888 03/08/28	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	0	5'000	0	5'000 CAD	94.55%	3'098'975.00	0.29	a)
US06368LAP13	4.2500 % BMO 4 1/4 09/14/24 H	0	2'500	0	2'500 USD	98.49%	2'240'656.86	0.21	a)
US064159MK98	3.4000 % BNS 3.4 02/11/24	0	2'000	0	2'000 USD	99.29%	1'807'213.69	0.17	a)
US06417XAL55	5.2500 % BNS 5 1/4 12/06/24	0	5'800	5'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06417XAP69	4.8500 % BNS 4.85 02/01/30	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US125094AQ51	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 144A	0	1'150	0	1'150 USD	98.14%	1'027'049.67	0.10	a)
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	3'000	0	0	3'000 USD	96.52%	2'635'066.27	0.25	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	0	5'670	770	4'900 USD	95.22%	4'246'204.35	0.40	a)
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	0	2'400	600	1'800 USD	93.53%	1'532'155.91	0.15	a)
US30216BHA35	2.5000 % EDC 2 1/2 01/24/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63307A2M63	0.5500 % NACN 0.55 11/15/24 MTN	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	550	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	95.52%	3'477'191.84	0.33	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	84.48%	1'537'693.28	0.15	a)
US748149AG65	2.6250 % Q 2 5/8 02/13/23	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	0	1'850	450	1'400 USD	90.41%	1'151'828.68	0.11	a)
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	2'500	0	500	2'000 USD	87.96%	1'600'918.33	0.15	a)
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	89.75%	2'042'015.69	0.19	a)
USC23264AS02	4.5000 % CADEPO 4 1/2 02/13/26 REGS	0	4'400	0	4'400 USD	98.12%	3'928'780.50	0.37	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	2'600	0	0	2'600 USD	89.22%	2'111'084.85	0.20	a)
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	950	0	0	950 EUR	49.87%	455'699.79	0.04	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	1'535	0	0	1'535 EUR	95.62%	1'411'899.05	0.13	a)
XS2381362966	0.2500 % BNS 0 1/4 11/01/28 EMTN	2'000	500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	2'300	3'200	0	5'500 GBP	36.35%	2'207'954.32	0.21	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	47.00%	452'124.79	0.04	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2539371653	3.3000 % ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS	3'500	0	1'500	2'000 EUR	97.64%	1'878'392.76	0.18	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	0	8'600	5'200	3'400 EUR	95.76%	3'131'715.93	0.30	a)
XS2597677090	4.3750 % MGCN 4 3/8 03/17/32	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CA</b>							<b>59'881'556.15</b>	<b>5.69</b>	
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	1'450	0	0	1'450 EUR	83.60%	1'166'047.56	0.11	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'700	0	700	2'000 EUR	91.10%	1'752'630.47	0.17	a)
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	0	4'000	1'100	2'900 EUR	91.56%	2'554'202.07	0.24	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	3'100	0	700	2'400 EUR	94.96%	2'192'361.79	0.21	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	0	5'100	3'300	1'800 EUR	101.26%	1'753'284.58	0.17	a)
US22546QAP28	3.6250 % CS 3 5/8 09/09/24 MTN	0	6'666	0	6'666 USD	97.63%	5'922'559.11	0.56	a)
US22550L2J94	4.7500 % CS 4 3/4 08/09/24	0	2'000	0	2'000 USD	98.71%	1'796'584.31	0.17	a)
US90352JAC71	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	90.81%	826'437.16	0.08	a)
USG253HFAN60	2.9970 % CS 2.997 12/14/23 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH3698DDS02	6.5370 % UBS 6.537 08/12/33 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097BT36	1.3640 % UBS 1.364 01/30/27 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	0	2'300	0	2'300 USD	93.45%	1'956'078.76	0.19	a)
XS2480543102	2.1250 % CS 2 1/8 05/31/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2589907653	5.5000 % CS 5 1/2 08/20/26 EMTN	0	6'500	6'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CH</b>							<b>19'920'185.81</b>	<b>1.89</b>	
US05890PAB22	2.8750 % BCICI 2 7/8 10/14/31 REGS	3'500	0	1'500	2'000 USD	77.94%	1'418'604.58	0.13	a)
US05956NAE22	4.0000 % BCICI 4 02/11/23 144A	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	0	3'500	0	3'500 EUR	94.63%	3'185'814.69	0.30	a)
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	98.98%	594'805.74	0.06	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	0	2'000	0	2'000 EUR	47.49%	913'580.27	0.09	a)
XS2637387056	0.7500 % BNCHIL 0 3/4 06/16/25 EMTN	0	800'000	0	800'000 JPY	100.00%	4'807'384.15	0.46	a)
XS2645248225	4.1250 % CHILE 4 1/8 07/05/34	0	3'600	0	3'600 EUR	94.21%	3'262'570.67	0.31	a)
<b>CL</b>							<b>14'182'760.10</b>	<b>1.35</b>	
CND100008593	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	15'000	0	0	15'000 CNY	108.68%	2'020'623.39	0.19	a)
CND10000H4F0	4.0400 % SDBC 4.04 04/10/27 1710	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	7'000	0	0	7'000 CNY	100.22%	869'587.67	0.08	a)
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	10'000	0	0	10'000 CNY	104.12%	1'290'570.33	0.12	a)
CND100029N10	3.8600 % EXIMCH 3.86 05/20/29 1910	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002D1Y9	3.8600 % CGB 3.86 07/22/49 1910	0	25'000	0	25'000 CNY	113.66%	3'522'190.06	0.33	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002GGR3	3.4500 % SDBC 3.45 09/20/29 1915	12'000	0	0	12'000 CNY	103.85%	1'544'635.51	0.15	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	70'000	0	40'000	30'000 CNY	105.17%	3'910'721.89	0.37	a)
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	20'000	10'000	0	30'000 CNY	100.00%	3'718'649.58	0.35	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	20'000	0	0	20'000 CNY	101.37%	2'512'977.85	0.24	a)
CND100035346	3.7900 % ADBCH 3.79 10/26/30 2010	10'000	0	0	10'000 CNY	106.01%	1'314'012.61	0.12	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	30'000	10'000	20'000	20'000 CNY	116.03%	2'876'356.52	0.27	a)
CND100047QT4	3.0200 % CGB 3.02 05/27/31 INBK	0	30'000	0	30'000 CNY	102.64%	3'816'647.25	0.36	a)
XS1553210672	0.8750 % SDBC 0 7/8 01/24/24	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2288096915	0.0000 % ICBCAS 0 01/19/23 FXCD	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	99.54%	2'467'480.61	0.23	a)
<b>CN</b>							<b>29'864'453.27</b>	<b>2.84</b>	
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	82.60%	2'383'712.10	0.23	a)
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	35'000	0	0	35'000 CZK	99.13%	1'357'842.73	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	10'000	0	0	10'000 CZK	79.12%	309'649.44	0.03	a)
CZ0001005920	1.5000 % CZGB 1 1/2 04/24/40 125	15'000	0	0	15'000 CZK	63.27%	371'383.26	0.04	a)
XS2495084621	5.6250 % CESDRA 5 5/8 10/12/27	3'750	0	3'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	0	1'900	0	1'900 EUR	101.16%	1'848'806.78	0.18	a)
XS2676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	0	1'800	900	900 EUR	100.55%	870'521.55	0.08	a)
<b>CZ</b>							<b>7'141'915.86</b>	<b>0.68</b>	
DE0001030559	0.5000 % DBRI 0 1/2 04/15/30 I/L	3'000	1'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030567	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/26 I/L	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	6'000	700	1'500	5'200 EUR	45.12%	2'256'960.94	0.21	a)
DE0001102317	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/23	1'700	3'000	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	0	3'000	0	3'000 EUR	99.47%	2'870'341.21	0.27	a)
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	0	6'000	2'000	4'000 EUR	98.07%	3'773'369.14	0.36	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	0	8'000	5'000	3'000 EUR	96.44%	2'782'902.07	0.26	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	1'000	4'500	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	1'000	1'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	2'000	0	0	2'000 EUR	71.70%	1'379'383.66	0.13	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	0	4'000	2'000	2'000 EUR	87.83%	1'689'720.46	0.16	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	2'000	3'500	1'000	4'500 EUR	42.32%	1'831'936.51	0.17	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	0	3'000	1'000	2'000 EUR	92.03%	1'770'580.02	0.17	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2LQSH4	0.7500 % KFW 0 3/4 06/28/28 GMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V5C3	5.3750 % DB 5 3/8 01/11/29	0	3'400	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	2'000	0	0	2'000 EUR	96.86%	1'863'386.71	0.18	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30WFB4	5.0000 % PBBGR 5 02/05/27 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3515S3	4.3750 % HASPA 4 3/8 02/12/29	0	4'300	4'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A351U49	5.8240 % ALVGR 5.824 07/25/53	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	0	8'000	1'000	7'000 EUR	45.38%	3'055'858.39	0.29	a)
DE000A3TOX22	0.2500 % PBBGR 0 1/4 10/27/25 EMTN	0	2'800	0	2'800 EUR	90.81%	2'445'737.14	0.23	a)
DE000BU0E071	0.0000 % BUBILL 0 07/17/24 364D	0	4'000	0	4'000 EUR	97.42%	3'748'397.53	0.36	a)
DE000BUZ2007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	0	3'000	1'000	2'000 EUR	96.24%	1'851'555.01	0.18	a)
DE000DL19WU8	3.2500 % DB 3 1/4 05/24/28	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000LB2ZTL3	2.0000 % LBBW 2 02/24/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 USD	95.32%	2'602'433.58	0.25	a)
US251526CE71	2.1290 % DB 2.129 11/24/26	0	2'000	0	2'000 USD	90.21%	1'641'978.01	0.16	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	0	1'200	0	1'200 USD	97.61%	1'065'937.92	0.10	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	300'000	0	200'000	100'000 JPY	104.21%	626'211.28	0.06	a)
US500769BR40	0.0000 % KFW 0 04/18/36	0	2'431	1'431	1'000 USD	52.64%	479'060.50	0.05	a)
US500769HX53	2.6250 % KFW 2 5/8 02/28/24	2'150	0	0	2'150 USD	99.06%	1'938'254.52	0.18	a)
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	2'000	0	0	2'000 CAD	91.26%	1'196'454.20	0.11	a)
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	1'300	0	0	1'300 USD	91.65%	1'084'224.41	0.10	a)
US515110BT00	2.5000 % RENTEN 2 1/2 11/15/27 37	1'700	0	500	1'200 USD	91.31%	997'188.72	0.09	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	4'000	0	4'000 USD	100.88%	3'672'243.73	0.35	a)
XS2046690827	1.2500 % KFW 1 1/4 08/28/23 EMTN	2'500	0	2'500	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	0	3'500	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	2'200	0	800	1'400 EUR	78.08%	1'051'501.33	0.10	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	16'000	0	0	16'000 CNY	99.87%	1'980'628.23	0.19	a)
XS2331271242	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 04/15/36 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	67.06%	967'659.79	0.09	a)
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	1'400	1'292	0	2'692 EUR	51.11%	1'323'600.46	0.13	a)
XS2381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	3'000	0	700	2'300 EUR	77.50%	1'714'678.61	0.16	a)
XS2422922943	1.0000 % BYLAN 1 12/20/24 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	94.82%	1'361'241.00	0.13	a)
XS2451378181	2.7500 % KFW 2 3/4 03/03/25 EMTN	20'000	20'000	10'000	30'000 CNY	99.86%	3'713'231.71	0.35	a)
XS2475954900	1.3750 % KFW 1 3/8 06/07/32	2'250	0	2'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2541394750	3.8750 % DBHNGR 3 7/8 10/13/42 EMTN	625	0	625	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	0	1'250	450	800 EUR	95.27%	733'118.98	0.07	a)
XS2590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	0	7'000	0	7'000 CNY	100.32%	870'420.61	0.08	a)
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	0	2'700	0	2'700 EUR	97.70%	2'537'388.55	0.24	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.
XS2629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	94.74%	1'002'419.98	0.10	a)
<b>DE</b>							<b>63'880'004.91</b>	<b>6.07</b>	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	5'000	0	0	5'000 DKK	115.83%	746'414.07	0.07	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	3'000	0	0	3'000 DKK	91.22%	352'686.49	0.03	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	6'000	0	0	6'000 DKK	79.15%	612'055.28	0.06	a)
US23636ABD28	3.7730 % DANBNK 3.773 03/28/25 144A	0	2'000	600	1'400 USD	98.74%	1'258'054.94	0.12	a)
US23636BAR06	3.8750 % DANBNK 3 7/8 09/12/23 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1718495515	2.2500 % KOMMUN 2 1/4 11/16/22	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1756367816	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/24/25 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	2'500	0	0	2'500 USD	89.99%	2'047'358.71	0.19	a)
XS2591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	2'550	2'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>DK</b>							<b>5'016'569.49</b>	<b>0.48</b>	
XS2532370231	4.0000 % ESTONI 4 10/12/32	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>EE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	1'300	0	0	1'300 EUR	57.44%	718'289.91	0.07	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	0	1'000	0	1'000 EUR	57.73%	555'310.67	0.05	a)
ES0205046008	4.2500 % AENASM 4 1/4 10/13/30 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	400'000	0	300'000	100'000 JPY	99.51%	597'961.20	0.06	a)
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	1'400	0	0	1'400 USD	86.74%	1'105'115.39	0.11	a)
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	0	4'000	0	4'000 USD	99.71%	3'629'679.82	0.35	a)
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	2'600	0	0	2'600 GBP	81.84%	2'349'860.21	0.22	a)
XS2476266205	4.7220 % SANTAN FLOAT 05/05/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2555187801	5.3750 % CABKSM 5 3/8 11/14/30 EMTN	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634826031	4.2500 % SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2645244745	0.7580 % SANSCF 0.758 07/07/25 EMTN	0	400'000	0	400'000 JPY	99.45%	2'390'447.99	0.23	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	0	700'000	200'000	500'000 JPY	98.89%	2'971'144.35	0.28	a)
XS2645245395	1.0650 % SANSCF 1.065 07/07/28 EMTN	0	200'000	0	200'000 JPY	96.78%	1'163'159.39	0.11	a)
XS2661068234	5.2500 % FCCSER 5 1/4 10/30/29	0	5'100	0	5'100 EUR	101.21%	4'965'137.66	0.47	a)
XS2698998593	5.1250 % ANESM 5 1/8 04/23/31 EMTN	0	7'800	0	7'800 EUR	99.86%	7'492'223.98	0.71	a)
<b>ES</b>							<b>27'938'330.57</b>	<b>2.66</b>	
US65559D2E87	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	87.76%	958'402.78	0.09	a)
USX6000LAB00	5.3750 % NDASS 5 3/8 09/22/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1241947768	2.3750 % FINNVE 2 3/8 06/04/25 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	95.29%	1'040'569.37	0.10	a)
XS1845379152	3.0000 % FINNVE 3 06/27/23 REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2242924491	0.0000 % KUNTA 0 10/14/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	79.66%	919'571.15	0.09	a)
XS2584643113	3.6250 % NDAFH 3 5/8 02/10/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	98.92%	1'903'133.52	0.18	a)
<b>FI</b>							<b>4'821'676.82</b>	<b>0.46</b>	
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013425451	1.7500 % BFCM 1 3/4 12/19/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	95.46%	2'108'329.88	0.20	a)
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	93.85%	563'979.01	0.05	a)
FR0013483914	1.0000 % SOGRPR 1 02/18/70 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	34.40%	661'863.29	0.06	a)
FR0014000511	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000C08	0.8750 % SNCF 0 7/8 02/28/51	800	0	0	800 EUR	42.60%	327'840.01	0.03	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	2'400	0	600	1'800 EUR	88.19%	1'526'929.75	0.15	a)
FR0014009HA0	2.5000 % BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	0	2'500	0	2'500 EUR	72.39%	1'740'846.86	0.17	a)
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	98.83%	2'375'497.33	0.23	a)
FR001400DHQ4	3.3750 % BPIFRA 3 3/8 11/25/32	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FOV4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	0	4'200	2'400	1'800 EUR	98.19%	1'700'145.82	0.16	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.
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	0	1'900	1'000	900 EUR	96.06%	831'606.80	0.08	a)
FR001400FDB0	4.2500 % EDF 4 1/4 01/25/32 EMTN	0	3'100	3'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GG20	4.1250 % BFCM 4 1/8 03/13/29 EMTN	0	3'100	600	2'500 EUR	99.25%	2'386'660.41	0.23	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	0	2'700	0	2'700 GBP	100.07%	2'983'727.40	0.28	a)
FR001400KWR6	6.0000 % ELOFR 6 03/22/29 EMTN	0	6'000	1'200	4'800 EUR	98.71%	4'557'593.36	0.43	a)
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	0	5'400	5'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFF 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	3'900	0	3'900 EUR	99.00%	3'713'848.97	0.35	a)
FR001400LH44	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 10/19/26	0	300'000	0	300'000 JPY	99.10%	1'786'526.43	0.17	a)
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	98.70%	5'931'152.49	0.56	a)
JP525020AJA9	0.4430 % BFCM 0.443 10/12/23 26	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP525020BPA4	1.2030 % BFCM 1.203 10/16/28 42	0	300'000	0	300'000 JPY	99.22%	1'788'704.71	0.17	a)
JP525022ANC3	0.7630 % ACAFP 0.763 12/05/25 17	0	400'000	0	400'000 JPY	99.75%	2'397'617.44	0.23	a)
JP525023BL76	0.0700 % CDCEPS 0.07 07/30/24 9	100'000	0	0	100'000 JPY	99.85%	600'021.65	0.06	a)
US05578QAB95	5.1500 % BPCEGP 5.15 07/21/24 144A	0	2'000	0	2'000 USD	98.65%	1'795'546.85	0.17	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06675GAY17	1.6040 % BFCM 1.604 10/04/26 REGS	3'300	0	800	2'500 USD	87.87%	1'999'106.84	0.19	a)
US09659X2N16	1.3230 % BNP 1.323 01/13/27 REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22535EAG26	5.5140 % ACAFP 5.514 07/05/33 REGS	0	2'250	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22535WAE75	3.7500 % ACAFP 3 3/4 04/24/23 144A	3'588	0	3'588	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'200	0	0	2'200 USD	89.23%	1'786'522.80	0.17	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	6'000	0	2'000	4'000 USD	94.24%	3'430'342.47	0.33	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	97.94%	1'782'605.94	0.17	a)
USF2893TAQ97	4.9500 % EDF 4.95 10/13/45 REGS	4'300	1'700	0	6'000 USD	76.46%	4'174'836.17	0.40	a)
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	0	2'150	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	0	3'500	0	3'500 EUR	96.00%	3'232'073.75	0.31	a)
XS1490307516	2.5600 % ACAFP 2.56 12/20/23 EMTN	1'024	0	0	1'024 USD	99.46%	926'877.63	0.09	a)
XS2626022573	4.1250 % WPPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>FR</b>							<b>57'110'804.06</b>	<b>5.43</b>	
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'200	1'800	1'500	1'500 GBP	99.27%	1'644'358.17	0.16	a)
GB00B6RNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	700	1'500	200	2'000 GBP	51.91%	1'146'484.44	0.11	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	900	0	400	500 GBP	54.06%	298'492.34	0.03	a)
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	0	3'000	0	3'000 GBP	81.91%	2'713'596.81	0.26	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	2'200	300	500	2'000 GBP	71.48%	1'578'707.52	0.15	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'900	0	0	2'900 GBP	46.69%	1'495'233.47	0.14	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	0	10'200	700	9'500 GBP	26.42%	2'771'683.00	0.26	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	3'000	4'900	0	7'900 GBP	63.86%	5'571'128.10	0.53	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	0	500	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	3'700	4'400	500	7'600 GBP	69.55%	5'837'109.84	0.56	a)
JP582666CG91	1.2070 % HSBC 1.207 09/25/26 3	200'000	0	0	200'000 JPY	98.93%	1'188'981.64	0.11	a)
JP582667AJ57	0.6500 % LLOYDS 0.65 05/30/23 6	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	0	400'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	0	1'900	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US53944YAL74	3.8700 % LLOYDS 3.87 07/09/25	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63859VBF76	1.0000 % NWIDE 1 08/28/25 REGS	1'900	0	0	1'900 USD	91.19%	1'576'830.89	0.15	a)
US639057AK45	5.8080 % NWG 5.808 09/13/29	0	5'300	3'000	2'300 USD	95.79%	2'004'960.95	0.19	a)
XS1395052639	4.0500 % STANLN 4.05 04/12/26 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1699636574	2.2500 % LLOYDS 2 1/4 10/16/24 EMTN	1'500	0	500	1'000 GBP	96.49%	1'065'583.41	0.10	a)
XS1876165819	5.7330 % HSBC 3.3 09/28/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 USD	99.40%	1'809'161.20	0.17	a)
XS1917601582	1.5000 % HSBC 1 1/2 12/04/24 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2078692014	3.5160 % STANLN 3.516 02/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	94.17%	856'971.11	0.08	a)
XS2100771547	1.8750 % LLOYDS 1 7/8 01/15/26	160	0	160	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	900	0	0	900 GBP	90.94%	903'855.33	0.09	a)
XS2305547064	1.6250 % SGELN 1 5/8 02/25/31	1'100	0	1'100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	600'000	0	0	600'000 JPY	97.50%	3'515'416.85	0.33	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	1'300	0	300	1'000 USD	82.04%	746'582.49	0.07	a)
XS2423041107	3.2600 % GS 3.26 07/08/24 EMTN	3'000	250	0	3'250 USD	97.66%	2'888'423.62	0.27	a)
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	3'000	0	1'000	2'000 USD	87.92%	1'600'250.12	0.15	a)
XS2473346299	2.0000 % NWIDE 2 04/28/27	1'000	0	1'000	0 EUR	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.
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	3'800	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596458591	4.2500 % BXBAU 4 1/4 03/22/31 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	0	3'800	800	3'000 EUR	98.73%	2'849'159.58	0.27	a)
XS2618731256	4.8740 % STANLN 4.874 05/10/31	0	5'250	2'750	2'500 EUR	97.64%	2'348'111.20	0.22	a)
XS2662538425	4.9180 % BACR 4.918 08/08/30 EMTN	0	4'000	800	3'200 EUR	98.35%	3'027'375.74	0.29	a)
XS2673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	0	6'200	4'300	1'900 EUR	100.13%	1'829'963.78	0.17	a)
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	0	4'800	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	3'400	1'400	2'000 EUR	98.47%	1'894'495.42	0.18	a)
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	3'200	1'200	2'000 EUR	98.31%	1'891'321.06	0.18	a)
<b>GB</b>							<b>55'054'238.08</b>	<b>5.24</b>	
HK0000895901	3.8750 % HKINTL 3 7/8 01/11/30 GMTN	0	8'600	8'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HK0000929684	3.7500 % HKINTL 3 3/4 06/07/32 GMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
HK0000929999	3.3000 % HKINTL 3.3 06/07/33 GMTN	0	10'000	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
USY3422VCW64	4.6250 % HKINTL 4 5/8 01/11/33 REGS	0	1'950	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3422VCX48	5.2500 % HKINTL 5 1/4 01/11/53 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1138283236	4.0800 % CCB 4.08 11/18/24 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	100.82%	1'249'630.75	0.12	a)
<b>HK</b>							<b>1'249'630.75</b>	<b>0.12</b>	
XS2630760796	6.5000 % MAGYAR 6 1/2 06/29/28	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>HU</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
JP536000BM53	0.5700 % INDON 0.57 05/27/26 20	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
<b>ID</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	0	8'000	0	8'000 USD	90.26%	6'571'076.09	0.62	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	5'400	0	1'000	4'400 USD	74.54%	2'984'708.47	0.28	a)
XS2560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	0	2'350	2'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2695009998	7.8750 % GLJGR 7 7/8 04/06/27 EMTN	0	6'700	2'700	4'000 EUR	103.50%	3'982'530.49	0.38	a)
<b>IE</b>							<b>13'538'315.05</b>	<b>1.29</b>	
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	1'500	0	0	1'500 ILS	92.71%	312'837.65	0.03	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	2'000	0	0	2'000 ILS	80.94%	364'134.45	0.03	a)
<b>IL</b>							<b>676'972.10</b>	<b>0.06</b>	
XS2182399274	0.6250 % ICELND 0 5/8 06/03/26	0	2'040	0	2'040 EUR	91.96%	1'804'578.74	0.17	a)
XS2293755125	0.0000 % ICELND 0 04/15/28	0	5'571	0	5'571 EUR	84.18%	4'511'331.07	0.43	a)
XS2411726438	0.7500 % LANBNN 0 3/4 05/25/26	0	3'400	2'400	1'000 EUR	88.63%	852'565.26	0.08	a)
XS2671896418	7.0750 % LANBNN FLOAT 08/25/25 EMTN	0	30'000	0	30'000 SEK	100.33%	2'451'713.86	0.23	a)
XS2679765037	6.3750 % LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	100.90%	3'882'451.63	0.37	a)
<b>IS</b>							<b>13'502'640.56</b>	<b>1.28</b>	
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	4'500	3'500	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	0	9'000	5'100	3'900 EUR	97.99%	3'676'047.32	0.35	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	5'500	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005568123	4.7500 % CDEP 4 3/4 10/18/30 EMTN	0	7'400	1'400	6'000 EUR	99.74%	5'756'265.63	0.55	a)
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	3'000	1'500	0	4'500 USD	88.25%	3'613'872.25	0.34	a)
XS2348714713	3.1270 % UCGIM 3.127 06/03/32 REGS	1'847	0	1'847	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2502220929	4.3750 % AMCOSP 4 3/8 03/27/26 EMTN	3'400	0	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2532681074	3.7500 % FERROV 3 3/4 04/14/27 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592658947	5.6250 % ISPIM 5 5/8 03/08/33 EMTN	0	3'400	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	0	500'000	0	500'000 JPY	99.68%	2'994'790.20	0.28	a)
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	1'150	1'150	0 EUR	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.
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	0	3'200	0	3'200 USD	98.06%	2'855'780.58	0.27	a)
XS2625196352	4.8750 % ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2638075700	6.6250 % ISPIM 6 5/8 06/20/33 REGS	0	4'200	1'700	2'500 USD	92.10%	2'095'344.62	0.20	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	4'000	2'000	2'000 EUR	99.69%	1'917'812.52	0.18	a)
<b>IT</b>							<b>22'909'913.12</b>	<b>2.18</b>	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	0	600'000	200'000	400'000 JPY	100.12%	2'406'456.26	0.23	a)
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	0	500'000	500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	250'000	0	250'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	300'000	100'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	0	500'000	500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1120201F51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/25 20	350'000	150'000	0	500'000 JPY	111.15%	3'339'476.35	0.32	a)
JP1120241K56	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/29 24	700'000	0	200'000	500'000 JPY	111.91%	3'362'403.51	0.32	a)
JP1120261M59	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/31 26	200'000	200'000	200'000	200'000 JPY	113.43%	1'363'207.26	0.13	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	250'000	50'000	100'000	200'000 JPY	105.28%	1'265'326.27	0.12	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	0	750'000	0	750'000 JPY	104.81%	4'723'430.87	0.45	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	400'000	100'000	0	500'000 JPY	101.20%	3'040'699.80	0.29	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	109.85%	6'601'127.52	0.63	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	500'000	0	0	500'000 JPY	106.89%	3'211'478.70	0.31	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	500'000	0	100'000	400'000 JPY	104.19%	2'504'380.72	0.24	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	450'000	0	150'000	300'000 JPY	102.31%	1'844'322.05	0.18	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	520'000	80'000	0	600'000 JPY	72.98%	2'631'269.09	0.25	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	500'000	0	100'000	400'000 JPY	77.73%	1'868'280.37	0.18	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	0	200'000	0	200'000 JPY	75.46%	906'870.84	0.09	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	0	700'000	0	700'000 JPY	64.64%	2'718'917.97	0.26	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	400'000	0	100'000	300'000 JPY	76.19%	1'373'538.33	0.13	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	200'000	300'000	0	500'000 JPY	63.98%	1'922'164.06	0.18	a)
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.55%	1'196'398.11	0.11	a)
JP316572DLC8	0.3800 % NTT 0.38 09/20/30 18	100'000	0	0	100'000 JPY	95.51%	573'940.97	0.05	a)
JP351265CL81	0.0010 % JFM 0.001 08/28/24 11	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP376260AJ97	0.3000 % NOMURA 0.3 09/04/23 1	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	0	7'200	3'700	3'500 USD	97.25%	3'097'728.92	0.29	a)
US86562MAA80	4.4360 % SUMIBK 4.436 04/02/24 144A	900	0	0	900 USD	99.27%	813'041.40	0.08	a)
US86562MCT53	5.4640 % SUMIBK 5.464 01/13/26	0	8'600	5'000	3'600 USD	98.65%	3'232'038.22	0.31	a)
USJ5539RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	1'350	0	0	1'350 USD	89.94%	1'105'022.75	0.11	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0171578502	1.0500 % DBJJP 1.05 06/20/23 INTL	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0257403278	2.3000 % DBJJP 2.3 03/19/26 INTL	100'000	240'000	0	340'000 JPY	104.57%	2'136'447.64	0.20	a)
XS0432572344	2.8500 % JAPEXP 2.85 03/18/39 1	230'000	0	0	230'000 JPY	112.29%	1'552'007.25	0.15	a)
XS1865126004	3.1250 % DBJJP 3 1/8 09/06/23 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1871094428	3.4000 % CJRAIL 3.4 09/06/23	2'699	0	2'699	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1880915472	3.3750 % JFM 3 3/8 09/27/23 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2059791231	2.2000 % CJRAIL 2.2 10/02/24	2'500	0	0	2'500 USD	96.72%	2'200'560.49	0.21	a)
XS2241387252	0.2140 % MIZUHO 0.214 10/07/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	94.94%	6'048'265.10	0.58	a)
XS2673433814	3.9760 % EJRAIL 3.976 09/05/32 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	94.98%	3'471'678.15	0.33	a)
XS2698464885	4.0860 % SUMITR 4.086 04/19/28 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	100.56%	5'803'707.27	0.55	a)
<b>JP</b>							<b>76'314'186.24</b>	<b>7.26</b>	
JP541037AP66	0.7600 % KOREAN 0.76 06/29/26 3	0	300'000	0	300'000 JPY	99.76%	1'798'316.30	0.17	a)
KR10350172C8	3.0000 % KTB 3 12/10/42 4212	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	84.67%	1'711'693.68	0.16	a)
KR103501GA35	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/25 2503	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	97.03%	1'961'435.39	0.19	a)
KR103502G3C1	3.7500 % KTB 3 3/4 12/10/33 3312	0	8'000'000	0	8'000'000 KRW	95.31%	5'137'870.06	0.49	a)
US50066CAR07	2.0000 % KORGAS 2 07/13/31 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50066RAR75	1.7500 % KOROL 1 3/4 04/18/25 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50066RAS58	2.1250 % KOROL 2 1/8 04/18/27 REGS	3'000	0	1'500	1'500 USD	88.85%	1'212'891.11	0.12	a)
US82460EAS90	5.3417 % SHNHAN FLOAT 04/29/23 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	89.72%	1'061'452.04	0.10	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.
USY3815NBF79	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 01/24/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2231588034	3.5500 % HYUCAP 3.55 09/21/23 GMTN	10'900	0	10'900	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2322585196	2.8500 % EIBKOR 2.85 03/25/24 EMTN	0	14'000	0	14'000 CNY	99.80%	1'731'869.69	0.16	a)
XS2369288886	3.2000 % HYUCAP 3.2 08/11/24 GMTN	10'000	7'000	0	17'000 CNY	99.48%	2'096'241.73	0.20	a)
XS2427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	2'200	0	0	2'200 USD	88.84%	1'778'662.81	0.17	a)
XS2690013052	5.7500 % KOLAHO 5 3/4 10/06/25	0	6'000	0	6'000 USD	99.94%	5'456'959.12	0.52	a)
<b>KR</b>							<b>23'947'391.93</b>	<b>2.28</b>	
US00653MAA99	4.0000 % ADCBUH 4 03/29/23 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAS17	2.8000 % BABA 2.8 06/06/23	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0897453493	4.5000 % ADCBUH 4 1/2 03/06/23 EMTN	1'706	0	1'706	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1672092118	0.7000 % HONHAI 0.7 09/20/24 EMTN	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2181280848	3.6000 % QNBK 3.6 06/05/25 EMTN	0	20'000	0	20'000 CNY	99.59%	2'468'918.44	0.23	a)
XS2227817876	3.8000 % QNBK 3.8 09/15/25 EMTN	6'120	7'000	0	13'120 CNY	99.85%	1'623'773.64	0.15	a)
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2250518102	1.5000 % CDBALF 1 1/2 11/04/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2297057767	1.3750 % CDBLFD 1 3/8 03/04/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2299092747	3.2800 % QNBK 3.28 02/18/24 EMTN	8'000	0	0	8'000 CNY	99.94%	991'047.90	0.09	a)
XS2336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.90%	1'238'301.68	0.12	a)
XS2454678009	4.0000 % QNBK 4 03/14/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.60%	1'234'508.80	0.12	a)
XS2597110613	7.0000 % BOSUH 7 03/14/28 EMTN	0	4'600	4'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>KY</b>							<b>7'556'550.46</b>	<b>0.72</b>	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LI</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2547270756	4.1250 % LITHUN 4 1/8 04/25/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2604821228	3.8750 % LITHUN 3 7/8 06/14/33 EMTN	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LT</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
AU3CB0252955	4.5000 % ARNDTN 4 1/2 05/14/25 MTN	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	0	3'500	1'600	1'900 EUR	94.57%	1'728'455.32	0.16	a)
XS1761721262	1.6250 % ARNDTN 1 5/8 01/31/28 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	75.76%	2'040'435.09	0.19	a)
XS1964701822	5.3750 % ARNDTN 5 3/8 03/21/29 EMTN	1'500	0	600	900 USD	77.19%	632'250.28	0.06	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	67.56%	1'104'710.30	0.11	a)
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	1'800	0	500	1'300 EUR	65.84%	823'282.29	0.08	a)
XS2432162654	1.7500 % CPIPGR 1 3/4 01/14/30 EMTN	5'100	0	1'300	3'800 EUR	58.55%	2'140'007.97	0.20	a)
XS2529520715	3.6250 % PRIFII 3 5/8 03/07/30 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>8'469'141.25</b>	<b>0.81</b>	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	100'000	0	100'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	100'000	0	100'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	300'000	0	0	300'000 MXN	87.10%	1'317'207.51	0.13	a)
XS0699618350	5.0000 % AMXLMM 5 10/27/26	0	1'920	1'220	700 GBP	98.39%	760'595.58	0.07	a)
<b>MX</b>							<b>2'077'803.09</b>	<b>0.20</b>	
JP545803AL22	0.2240 % MAYMK 0.224 02/13/23 6	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
MYBM12300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	0	10'000	0	10'000 MYR	98.60%	1'883'361.31	0.18	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	0	10'000	0	10'000 MYR	96.21%	1'837'615.27	0.17	a)
<b>MY</b>							<b>3'720'976.58</b>	<b>0.35</b>	
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3.7 05/30/31 EMTN	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	1'000	5'000	2'000	4'000 EUR	95.31%	3'667'249.39	0.35	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	1'000	0	0	1'000 EUR	40.66%	391'119.40	0.04	a)
US29278GAP37	2.2500 % ENELIM 2 1/4 07/12/31 144A	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'200	0	0	1'200 USD	92.03%	1'005'020.14	0.10	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	0	1'200	0	1'200 USD	93.66%	1'022'790.29	0.10	a)
US749775DJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	90.79%	1'652'414.19	0.16	a)
USN27915AK84	2.4850 % DT 2.485 09/19/23 REGS	947	0	947	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN30706VC11	1.3750 % ENELIM 1 3/8 07/12/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	88.22%	2'408'565.63	0.23	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	2'300	0	0	2'300 USD	91.87%	1'923'007.54	0.18	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	0	3'600	600	3'000 EUR	74.77%	2'157'697.80	0.21	a)
XS1596070547	3.0000 % MUBAUH 3 04/19/24 GMTN	0	2'195	0	2'195 USD	98.40%	1'965'578.82	0.19	a)
XS1881598772	3.0000 % BNG 3 09/20/23 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1917719319	3.1250 % NEDWBK 3 1/8 12/05/22 REGS	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X51987905913	1.9700 % RABOBK 1.97 05/29/24 EMTN	1'334	0	0	1'334 USD	97.36%	1'181'896.22	0.11	a)
X52065581212	1.5000 % BNG 1 1/2 10/16/24 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	96.10%	1'749'043.30	0.17	a)
X52199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	1'000	0	0	1'000 EUR	67.10%	645'414.35	0.06	a)
X52265251905	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	90.76%	908'567.53	0.09	a)
X52342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52381867907	4.1720 % TOYOTA FLOAT 08/25/23 EMTN	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52384269366	0.7500 % HEIBOS 0 3/4 09/06/29 EMTN	2'000	0	800	1'200 EUR	63.13%	728'728.74	0.07	a)
X52428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	1'800	0	1'000	800 EUR	72.77%	560'002.95	0.05	a)
X52434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	3'900	0	2'600	1'300 EUR	88.93%	1'112'111.37	0.11	a)
X52435603571	0.6250 % HEIBOS 0 5/8 07/24/25 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52443920249	1.2500 % INTNED 1 1/4 02/16/27	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52477154871	2.1250 % LPTY 2 1/8 05/06/25 EMTN	4'500	0	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52483607474	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/23/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52524746687	4.1250 % INTNED 4 1/8 08/24/33	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52573331324	3.6250 % ABNANV 3 5/8 01/10/26 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52575971994	4.0000 % ABNANV 4 01/16/28 EMTN	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52613658470	3.7500 % ABNANV 3 3/4 04/20/25 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52613658710	4.3750 % ABNANV 4 3/8 10/20/28	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	0	4'900	2'900	2'000 EUR	97.39%	1'873'583.13	0.18	a)
X52637069357	6.7500 % ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52679898184	4.8750 % REWEEG 4 7/8 09/13/30	0	2'900	900	2'000 EUR	100.43%	1'932'087.32	0.18	a)
X52697483118	4.1250 % INTNED 4 1/8 10/02/26 EMTN	0	2'300	800	1'500 EUR	100.49%	1'449'902.66	0.14	a)
<b>NL</b>							<b>28'334'780.77</b>	<b>2.69</b>	
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	10'000	0	0	10'000 NOK	84.36%	687'190.94	0.07	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	22'900	0	22'900	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
US25601C2881	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	85.53%	778'365.77	0.07	a)
US656531AG58	6.8000 % EQNR 6.8 01/15/28	1'500	0	0	1'500 USD	103.79%	1'416'865.95	0.13	a)
X51188118100	2.1250 % KBN 2 1/8 02/11/25 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	95.80%	1'046'138.88	0.10	a)
X52465774474	2.6250 % DNBNO 2 5/8 06/10/26	3'300	0	1'000	2'300 GBP	94.78%	2'407'333.51	0.23	a)
X52631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52631835332	3.5000 % STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN	0	2'350	2'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>NO</b>							<b>6'335'895.05</b>	<b>0.60</b>	
AU3CB0301240	4.7000 % NZLGFA 4.7 08/01/28 MTN	0	3'100	2'800	300 AUD	97.52%	168'569.08	0.02	a)
NZIBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	3'500	0	0	3'500 NZD	116.57%	2'159'729.75	0.21	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	0	2'650	0	2'650 USD	97.44%	2'349'822.36	0.22	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	88.34%	1'366'741.30	0.13	a)
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	77.83%	708'273.71	0.07	a)
X51245411233	4.5000 % FCGNZ 4 1/2 07/17/25 EMTN	0	30'000	0	30'000 CNY	101.61%	3'778'417.23	0.36	a)
X52353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	1'000	0	0	1'000 EUR	84.14%	809'393.99	0.08	a)
X52362968906	0.1000 % WSTPNZ 0.1 07/13/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>NZ</b>							<b>11'340'947.42</b>	<b>1.08</b>	
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	4'300	0	2'800	1'500 USD	94.16%	1'285'388.23	0.12	a)
<b>PE</b>							<b>1'285'388.23</b>	<b>0.12</b>	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	8'000	5'000	6'000	7'000 PLN	90.34%	1'365'679.69	0.13	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	3'000	0	0	3'000 PLN	87.05%	563'976.17	0.05	a)
X52388876232	0.9660 % MBKPW 0.966 09/21/27 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52486282358	3.0000 % BGOSK 3 05/30/29 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52625207571	5.3750 % BGOSK 5 3/8 05/22/33 REGS	0	2'050	2'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	0	1'700	0	1'700 USD	101.09%	1'563'971.41	0.15	a)
<b>PL</b>							<b>3'493'627.27</b>	<b>0.33</b>	
X52357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	78.12%	1'066'414.72	0.10	a)
<b>QA</b>							<b>1'066'414.72</b>	<b>0.10</b>	
X52538441598	6.6250 % ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>RO</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	1'000	4'000	0	5'000 SEK	104.56%	425'821.93	0.04	a)
SE0012230415	1.0000 % NDAFH 1 09/18/24 #5534 5534	10'000	10'000	20'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
XS1968465572	0.3750 % KOMINS 0 3/8 03/27/24 G24	10'000	0	10'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	98.99%	2'379'439.30	0.23	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REG5	4'000	0	0	4'000 SEK	83.04%	270'545.74	0.03	a)
XS2572496623	4.2500 % SWEDA 4 1/4 07/11/28 GMTN	0	5'900	5'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618499177	3.7500 % SHBASS 3 3/4 05/05/26 EMTN	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2619751576	3.8750 % SEB 3 7/8 05/09/28 EMTN	0	4'950	4'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2626343375	3.6250 % VLVY 3 5/8 05/25/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	0	2'750	0	2'750 EUR	98.38%	2'602'550.43	0.25	a)
<b>SE</b>							<b>5'678'357.40</b>	<b>0.54</b>	
AU3CB0302107	4.7530 % CLFCAP 4.753 08/31/28 MTN	0	3'350	1'350	2'000 AUD	97.89%	1'128'092.28	0.11	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	3'900	0	0	3'900 SGD	97.66%	2'529'939.66	0.24	a)
US233045AC70	2.3750 % DBSSP 2 3/8 03/17/27 REG5	3'500	0	0	3'500 USD	90.69%	2'888'507.80	0.27	a)
US716973AE24	4.7500 % PFE 4 3/4 05/19/33	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	90.57%	1'236'391.20	0.12	a)
XS2463967369	4.5000 % UOBSP 4 1/2 04/06/32 GMTN	20'000	7'000	0	27'000 CNY	102.60%	3'433'807.85	0.33	a)
<b>SG</b>							<b>11'216'738.79</b>	<b>1.07</b>	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOSPO 5 3/8 10/04/28 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	100.50%	1'546'701.20	0.15	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	0	4'900	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>SK</b>							<b>1'546'701.20</b>	<b>0.15</b>	
TH0623036C06	2.1250 % THAIGB 2 1/8 12/17/26	80'000	10'000	40'000	50'000 THB	98.34%	1'244'990.32	0.12	a)
TH0623036I02	3.3000 % THAIGB 3.3 06/17/38	50'000	0	20'000	30'000 THB	96.51%	733'060.20	0.07	a)
TH062303M604	2.0000 % THAIGB 2 06/17/42	40'000	0	20'000	20'000 THB	77.72%	393'579.16	0.04	a)
TH0623A3C606	3.7750 % THAIGB 3.775 06/25/32	100'000	0	70'000	30'000 THB	104.34%	792'520.34	0.08	a)
TH0623A3G607	4.0000 % THAIGB 4 06/17/66	0	20'000	20'000	0 THB	0.00%	0.00	0.00	
<b>TH</b>							<b>3'164'150.02</b>	<b>0.30</b>	
AU3CB0278885	3.8500 % VZ 3.85 03/23/41 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	62.85%	362'129.02	0.03	a)
US00287YAL39	2.9000 % ABBV 2.9 11/06/22	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CH74	3.6000 % AMZN 3.6 04/13/32	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02343UAJ43	5.6250 % AMCR 5 5/8 05/26/33	0	1'900	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02665WEQ06	5.8000 % HND 5.8 10/03/25 GMTN	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XCE85	5.8000 % AMT 5.8 11/15/28	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DH07	4.0500 % AMGN 4.05 08/18/29	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DK36	4.8750 % AMGN 4 7/8 03/01/53	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DQ06	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/30	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AU73	4.5500 % ELV 4.55 05/15/52	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AK68	2.4000 % AAPL 2.4 05/03/23	1'176	0	1'176	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833CX61	3.0000 % AAPL 3 06/20/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04685A3B58	5.7157 % ATH FLOAT 08/19/24 144A	0	2'000	0	2'000 USD	99.17%	1'805'065.97	0.17	a)
US04686E3F70	0.9140 % ATH 0.914 08/19/24 REG5	3'200	0	0	3'200 USD	95.69%	2'786'733.27	0.27	a)
US04686E3H37	1.9850 % ATH 1.985 08/19/28 REG5	2'000	0	0	2'000 USD	81.13%	1'476'592.53	0.14	a)
US06051GFP90	3.9500 % BAC 3.95 04/21/25 L	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	2'300	0	0	2'300 USD	82.47%	1'726'172.83	0.16	a)
US06051GKB40	2.9720 % BAC 2.972 07/21/52	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLA57	4.8270 % BAC 4.827 07/22/26 MTN	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	0	1'000	0	1'000 USD	90.36%	822'285.52	0.08	a)
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	0	6'000	0	6'000 USD	99.15%	5'413'874.35	0.51	a)
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	0	4'000	0	4'000 USD	99.72%	3'630'074.71	0.35	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	2'100	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	2'100	900	1'200 USD	84.72%	925'140.72	0.09	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	3'300	0	800	2'500 USD	88.00%	2'002'121.49	0.19	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.
US17325FBB31	5.8030 % C 5.803 09/29/28	0	5'500	0	5'500 USD	98.76%	4'943'040.67	0.47	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	2'200	0	0	2'200 USD	77.01%	1'541'863.63	0.15	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	0	1'180	0	1'180 USD	96.56%	1'036'919.69	0.10	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	1'000	0	0	1'000 USD	73.98%	673'259.75	0.06	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	0	1'100	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	1'700	0	0	1'700 USD	78.01%	1'206'893.36	0.11	a)
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	1'550	0	0	1'550 USD	53.31%	751'912.80	0.07	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8E53	4.4500 % META 4.45 08/15/52 144A	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8J41	4.4500 % META 4.45 08/15/52	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAT70	5.9500 % GM 5.95 04/01/49	2'700	0	1'700	1'000 USD	80.94%	736'553.26	0.07	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	0	3'200	1'300	1'900 USD	95.77%	1'655'916.14	0.16	a)
US37045XEHS2	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	2'100	0	2'100 USD	96.86%	1'851'152.35	0.18	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	900	0	0	900 USD	88.59%	725'613.01	0.07	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	0	1'150	0	1'150 USD	98.97%	1'035'746.26	0.10	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US418056AZ06	3.9000 % HAS 3.9 11/19/29	0	1'790	1'790	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	0	1'750	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CBS17	1.3000 % HYNMTR 1.3 01/08/26 REGS	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	82.32%	1'273'529.43	0.12	a)
US44891CXY84	1.0000 % HYNMTR 1 09/17/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	0	750	0	750 USD	96.77%	660'518.84	0.06	a)
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	0	2'650	0	2'650 USD	98.29%	2'370'417.70	0.23	a)
US458140BK55	3.1000 % INTC 3.1 02/15/60	500	0	0	500 USD	53.97%	245'586.15	0.02	a)
US458140CA64	4.1500 % INTC 4.15 08/05/32	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CB48	4.9000 % INTC 4.9 08/05/52	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	0	2'000	0	2'000 USD	94.39%	1'718'009.64	0.16	a)
US459200HU86	3.6250 % IBM 3 5/8 02/12/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJY71	3.8750 % JPM 3 7/8 09/10/24	0	4'500	0	4'500 USD	98.06%	4'015'736.68	0.38	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	3'100	0	0	3'100 USD	77.92%	2'198'194.86	0.21	a)
US46647PDE34	3.8450 % JPM 3.845 06/14/25	1'950	0	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDM59	5.5460 % JPM 5.546 12/15/25	0	6'700	6'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US478160CT90	2.4500 % JNJ 2.45 09/01/60	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457CG18	4.8750 % LLY 4 7/8 02/27/53	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EF07	4.4500 % LOW 4.45 04/01/62	3'000	0	0	3'000 USD	68.28%	1'864'023.92	0.18	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	0	4'200	4'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	0	6'000	0	6'000 USD	99.98%	5'458'966.38	0.52	a)
US61747YDU64	4.1000 % MS 4.1 05/22/23 MTN	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	0	1'575	0	1'575 USD	91.26%	1'308'127.37	0.12	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	0	8'000	2'000	6'000 USD	96.34%	5'260'616.83	0.50	a)
US65339KBP49	6.0510 % NEE 6.051 03/01/25	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US682680BN20	6.6250 % OKE 6 5/8 09/01/53	0	4'500	0	4'500 USD	93.44%	3'826'654.33	0.36	a)
US68389XBZ78	3.6500 % ORCL 3.65 03/25/41	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	0	4'500	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBF21	6.4990 % SANUSA 6.499 03/09/29	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBG04	6.5650 % SANUSA 6.565 06/12/29	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US817826AB63	0.8000 % SVELEV 0.8 02/10/24 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US817826AF77	2.5000 % SVELEV 2 1/2 02/10/41 144A	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	0	1'650	0	1'650 USD	99.29%	1'490'963.94	0.14	a)
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	0	3'700	0	3'700 USD	94.45%	3'180'196.09	0.30	a)
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	0	5'000	0	5'000 USD	99.37%	4'521'464.37	0.43	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	2'000	2'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	3'500	1'500	0	5'000 USD	82.66%	3'761'066.02	0.36	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	10'000	7'000	0	17'000 USD	73.20%	11'325'144.89	1.08	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	20'000	18'000	5'000	33'000 USD	70.67%	21'223'931.65	2.02	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	5'000	6'000	0	11'000 USD	72.72%	7'279'546.83	0.69	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	3'000	0	0	3'000 USD	68.83%	1'879'110.92	0.18	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	4'000	0	0	4'000 USD	68.77%	2'503'206.10	0.24	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'000	3'000	0	5'000 USD	43.94%	1'999'266.09	0.19	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	4'000	11'000	0	15'000 USD	45.47%	6'206'825.39	0.59	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	6'000	8'000	0	14'000 USD	54.44%	6'935'718.56	0.66	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	2'500	0	0	2'500 USD	52.47%	1'193'729.65	0.11	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	7'000	11'000	0	18'000 USD	61.59%	10'089'610.59	0.96	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	9'000	0	1'000	8'000 USD	54.05%	3'934'829.05	0.37	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	10'000	28'000	12'000	26'000 USD	52.14%	12'337'148.52	1.17	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	12'000	8'000	6'000	14'000 USD	57.55%	7'331'875.34	0.70	a)
US912810TP30	1.5000 % T 1 1/2 02/15/53	0	8'500	0	8'500 USD	80.73%	6'244'733.63	0.59	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	3'000	14'000	6'000	11'000 USD	90.44%	9'053'291.16	0.86	a)
US9128283R96	0.5000 % T 1 0 1/2 01/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	114.20%	1'039'266.13	0.10	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	5'000	800	5'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	3'000	5'000	4'000	4'000 USD	87.88%	3'198'825.75	0.30	a)
US912828N308	2.1250 % T 2 1/8 12/31/22	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V491	0.3750 % T 1 0 3/8 01/15/27	3'000	0	1'000	2'000 USD	118.06%	2'148'840.25	0.20	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	0	10'000	3'000	7'000 USD	96.58%	6'152'737.82	0.59	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	0	7'000	0	7'000 USD	83.95%	5'348'107.58	0.51	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	3'000	12'000	5'000	10'000 USD	81.75%	7'439'658.75	0.71	a)
US912828ZD51	0.5000 % T 0 1/2 03/15/23	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZZ63	0.1250 % T 1 0 1/8 07/15/30	3'000	0	1'500	1'500 USD	102.55%	1'399'905.37	0.13	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	0	11'000	5'030	5'970 USD	99.80%	5'422'387.20	0.52	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	0	9'000	4'000	5'000 USD	90.61%	4'122'953.31	0.39	a)
US91282CCA71	0.1250 % T 1 0 1/8 04/15/26	7'000	0	5'000	2'000 USD	109.44%	1'991'919.71	0.19	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	7'000	0	7'000 USD	97.25%	6'194'916.55	0.59	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	5'000	2'000	0	7'000 USD	76.58%	4'878'294.27	0.46	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	4'600	6'000	2'600	8'000 USD	79.47%	5'785'642.88	0.55	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	0	8'000	3'000	5'000 USD	95.27%	4'334'823.87	0.41	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	8'500	2'500	6'000 USD	89.52%	4'887'821.40	0.46	a)
US91282CHP95	1.3750 % T 1 3/8 07/15/33	0	2'000	0	2'000 USD	91.39%	1'663'466.23	0.16	a)
US92343VGN82	2.3550 % VZ 2.355 03/15/32	0	4'000	1'200	2'800 USD	74.66%	1'902'541.79	0.18	a)
US92826CAC64	2.8000 % V 2.8 12/14/22	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	3'150	0	3'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94974BFN55	4.1250 % WFC 4 1/8 08/15/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94988J6D46	5.4500 % WFC 5.45 08/07/26 BKNT	0	5'250	0	5'250 USD	99.03%	4'731'619.30	0.45	a)
US958102AQ89	2.8500 % WDC 2.85 02/01/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU09513GW34	2.2500 % BMW 2 1/4 09/15/23 REGS	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU3822UAA89	5.0000 % HWQCUS 5 07/27/28 REGS	0	2'400	0	2'400 USD	96.55%	2'108'728.39	0.20	a)
USU3822UAB62	5.0000 % HWQCUS 5 07/27/28 JUL	0	2'400	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU5876JAE56	4.9500 % MBGGR 4.95 03/30/25 REGS	0	1'050	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU7000RAG75	5.1500 % NSCCLF 5.15 05/30/25 REGS	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU74078CK74	1.1500 % NESNVX 1.15 01/14/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU85861AE97	6.3750 % STLA 6 3/8 09/12/32 REGS	3'800	0	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1074382893	2.1250 % WFC 2 1/8 06/04/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1308289146	2.5000 % GS 2 1/2 11/26/22 EMTN	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	300'000	0	0	300'000 JPY	98.08%	1'768'030.48	0.17	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	500'000	0	0	500'000 JPY	99.58%	2'991'996.08	0.28	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	0	600'000	0	600'000 JPY	100.00%	3'605'357.84	0.34	a)
XS1645684157	0.2980 % WMT 0.298 07/18/24	0	100'000	0	100'000 JPY	99.95%	600'622.56	0.06	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	0	100'000	0	100'000 JPY	98.49%	591'831.23	0.06	a)
XS1659697665	0.6980 % GLW 0.698 08/09/24	0	250'000	0	250'000 JPY	99.86%	1'500'099.20	0.14	a)
XS1717575259	2.3750 % NESNVX 2 3/8 11/17/22 EMTN	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1762729538	4.6500 % C 4.65 06/12/24 GMTN	3'000	0	0	3'000 USD	98.93%	2'700'828.19	0.26	a)
XS1793332286	0.5090 % KKR 0.509 03/23/23 REGS	100'000	0	100'000	0 JPY	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.
XS1793332526	0.7640 % KKR 0.764 03/21/25 REGS	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2045001935	2.0500 % C 2.05 09/30/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 USD	92.56%	1'263'445.17	0.12	a)
XS2056488013	1.8000 % TOYOTA 1.8 10/22/26 EMTN	2'700	0	0	2'700 USD	89.62%	2'202'010.67	0.21	a)
XS2149207354	3.3750 % GS 3 3/8 03/27/25	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193854804	0.8500 % PLD 0.85 06/24/30	100'000	200'000	0	300'000 JPY	92.47%	1'666'915.10	0.16	a)
XS2292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	1'800	0	300	1'500 EUR	77.55%	1'118'932.39	0.11	a)
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	2'500	0	2'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2384288747	1.5500 % GM 1.55 07/30/27	1'150	0	1'150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2410427079	4.0600 % C 4.06 03/28/24 GMTN	0	4'000	0	4'000 CNY	100.25%	497'051.02	0.05	a)
XS2446386356	2.1030 % MS 2.103 05/08/26	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	87.34%	840'175.65	0.08	a)
XS2484340075	2.7500 % PPG 2 3/4 06/01/29	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2548076053	0.8530 % TMO 0.853 10/20/25	300'000	0	0	300'000 JPY	99.79%	1'798'893.18	0.17	a)
XS2548076301	1.0540 % TMO 1.054 10/20/27	300'000	0	0	300'000 JPY	98.76%	1'780'397.14	0.17	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	0	3'100	3'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	0	7'500	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2580271596	3.8750 % PLD 3 7/8 01/31/30 EMTN	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592659671	4.2500 % VFC 4 1/4 03/07/29 EMTN	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	0	3'100	3'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597093009	4.0500 % TOYOTA 4.05 09/13/29 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597740476	4.1090 % NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN	0	2'200	1'200	1'000 EUR	99.39%	956'049.34	0.09	a)
XS2634234020	0.8130 % PYPL 0.813 06/09/25	0	200'000	0	200'000 JPY	99.79%	1'199'346.25	0.11	a)
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	0	360'000	0	360'000 JPY	99.27%	2'147'530.92	0.20	a)
XS2634234376	1.2400 % PYPL 1.24 06/09/28	0	230'000	0	230'000 JPY	98.48%	1'361'047.59	0.13	a)
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969698	5.1250 % O 5 1/8 07/06/34	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2657613720	3.7500 % HND4 3 3/4 10/25/27	0	4'450	4'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>US</b>							<b>295'144'118.80</b>	<b>28.07</b>	
XS2369276014	1.5000 % CONAMP 1 1/2 09/09/26	2'950	0	2'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2408454077	0.7500 % SINOCH 0 3/4 11/25/25 EMTN	5'300	0	5'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>VG</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	715	0	0	715 AUD	100.02%	412'055.84	0.04	a)
AU3CB0230134	4.5000 % CAF 4 1/2 06/05/25 MTN	1'094	0	0	1'094 AUD	97.36%	613'731.87	0.06	a)
AU3CB0258010	3.4000 % CAF 3.4 10/26/23	750	0	750	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0293975	4.4500 % IFC 4.45 05/14/27	0	2'000	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0295764	4.7500 % EIB 4 3/4 01/20/33	0	2'500	1'200	1'300 AUD	93.61%	701'200.32	0.07	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	0	4'000	1'000	3'000 CAD	96.90%	1'905'631.51	0.18	a)
EU000A3K4D09	2.7500 % EU 2 3/4 12/04/37 SURE	0	5'300	5'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	0	8'800	1'300	7'500 EUR	94.05%	6'785'479.11	0.65	a)
EU000A3K4D56	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	0	1'150	500	650 EUR	74.71%	467'132.29	0.04	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	0	5'000	1'000	4'000 EUR	94.79%	3'647'202.84	0.35	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	0	3'000	0	3'000 EUR	82.80%	2'389'483.66	0.23	a)
EU000A3K7MW2	1.6250 % EU 1 5/8 12/04/29 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	800	1'200	0	2'000 EUR	46.35%	891'686.82	0.08	a)
JP500113AL71	0.7700 % CAF 0.77 07/30/25 14	100'000	0	0	100'000 JPY	100.10%	601'499.89	0.06	a)
US00828EDC03	3.0000 % AFDB 3 09/20/23	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	0	3'600	3'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US222213AR10	2.6250 % COE 2 5/8 02/13/23	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29874QAY08	1.6250 % EBRD 1 5/8 09/27/24	2'000	0	0	2'000 USD	96.51%	1'756'614.91	0.17	a)
US298785HM16	2.3750 % EIB 2 3/8 05/24/27	850	0	0	850 USD	91.81%	710'208.29	0.07	a)
US298785HT68	3.1250 % EIB 3 1/8 12/14/23 GMTN	1'300	0	0	1'300 USD	99.73%	1'179'811.57	0.11	a)
US298785JS67	2.7500 % EIB 2 3/4 08/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	95.90%	872'722.34	0.08	a)
US459058GL16	3.0000 % IBRD 3 09/27/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	2'500	0	0	2'500 USD	78.10%	1'776'820.51	0.17	a)
US45950KCP30	2.8750 % IFC 2 7/8 07/31/23 GMTN	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45950VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	1'250	0	0	1'250 USD	93.26%	1'060'914.62	0.10	a)
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	300'000	0	200'000	100'000 JPY	105.89%	636'315.73	0.06	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	300'000	0	200'000	100'000 JPY	107.12%	643'694.29	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.
X50876282137	0.0000 % EIB 0 01/18/33 GDIF	10'000	0	0	10'000 JPY	91.62%	55'057.87	0.01	a)
X51751359016	1.3750 % EIB 1 3/8 05/12/28 EMTN	20'000	0	0	20'000 SEK	90.73%	1'478'036.56	0.14	a)
X51757690992	5.7500 % EIB 5 3/4 01/24/25 REGS	0	10'000'000	0	10'000'000 IDR	99.46%	569'777.70	0.05	a)
X51789715064	8.5000 % CAF 8 1/2 03/08/28 EMTN	0	50'000	0	50'000 MXN	89.92%	2'266'328.28	0.22	a)
X51824248626	0.8750 % AFDB 0 7/8 05/24/28 GDIF	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51850111789	0.3750 % EIB 0 3/8 07/16/25 EARN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52045838039	6.7525 % CABEI FLOAT 11/15/24 EMTN	3'305	0	0	3'305 USD	100.33%	3'017'670.79	0.29	a)
X52158595251	2.0000 % CABEI 2 05/06/25 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	0	12'000	0	12'000 CNY	99.08%	1'473'690.93	0.14	a)
X52289410420	0.2000 % IBRD 0.2 01/21/61	800	1'200	0	2'000 EUR	29.53%	568'190.87	0.05	a)
X52289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	1'000	0	0	1'000 CAD	86.69%	568'278.93	0.05	a)
X52290963466	0.0500 % EIB 0.05 01/27/51	0	2'000	0	2'000 EUR	36.75%	707'016.13	0.07	a)
X52296644094	4.2500 % EBRD 4 1/4 02/07/28 EMTN	0	20'000'000	0	20'000'000 IDR	91.84%	1'052'348.55	0.10	a)
X52311552363	5.0000 % AIIB 5 03/05/26 GMTN	30'000	0	0	30'000 MXN	86.87%	1'313'762.65	0.12	a)
X52318315921	2.5000 % AIIB 2 1/2 03/24/25 GMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.39%	1'231'881.05	0.12	a)
X52332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	0	40'000	0	40'000 CNY	99.85%	4'950'777.30	0.47	a)
X52406749478	5.1000 % IADB 5.1 11/17/26 EMTN	0	20'000'000	0	20'000'000 IDR	96.76%	1'108'664.62	0.11	a)
X52437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	20'000	0	20'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52457458854	3.0500 % IBRD 3.05 03/16/24 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.99%	1'239'404.84	0.12	a)
X52472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27	2'500	3'000	600	4'900 EUR	93.81%	4'421'537.49	0.42	a)
X52528875714	2.5000 % IDAWBG 2 1/2 01/15/38 GMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	0	20'000	0	20'000 CNY	99.86%	2'475'636.55	0.24	a)
X52574388562	6.0000 % EBRD 6 01/17/30 GMTN	0	30'000'000	0	30'000'000 IDR	96.86%	1'664'801.57	0.16	a)
X52594907664	4.5000 % CAF 4 1/2 03/07/28	0	2'000	0	2'000 EUR	101.20%	1'946'978.14	0.19	a)
X52707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	0	60'000	0	60'000 CNY	98.02%	7'289'547.81	0.69	a)
<b>XS</b>							<b>66'451'595.04</b>	<b>6.32</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

**-2'118'091.97 -0.20**

#### Futures

**0.00 0.00**

12/22	EURO-BOBL FUTURE DEC22	-360	440	80	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 10YR NOTE (CBT)DEC22	-90	90	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 10YR ULTRA FUT DEC22	0	180	180	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 5YR NOTE (CBT) DEC22	-50	50	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	610	610	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUXL 30Y BND MAR23	0	24	24	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR ULTRA FUT MAR23	0	280	280	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US ULTRA BOND CBT MAR23	0	108	108	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 5YR NOTE (CBT) MAR23	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	385	385	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-SCHATZ FUT JUN23	0	150	150	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUXL 30Y BND JUN23	0	24	24	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR ULTRA FUT JUN23	0	60	60	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US ULTRA BOND CBT JUN23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 5YR NOTE (CBT) JUN23	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 2YR NOTE (CBT) JUN23	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	180	180	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-SCHATZ FUT SEP23	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUXL 30Y BND SEP23	0	24	24	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	US LONG BOND(CBT) SEP23	0	40	40	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 10YR ULTRA FUT SEP23	0	40	40	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US ULTRA BOND CBT SEP23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 5YR NOTE (CBT) SEP23	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 2YR NOTE (CBT) SEP23	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-SCHATZ FUT DEC23	0	100	0	100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	0	0	70	-70 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO-BTP FUTURE DEC23	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	170	0	170 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	130	0	130 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US LONG BOND(CBT) DEC23	0	30	40	-10 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	0	70	0	70 USD	0.00	0.00	0.00	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.
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	0	100	0	100 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	0	50	0	50 USD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

USD/KRW	Verfall 07.12.2022	7'600'000'000	5'771'905		KRW/USD		0.00	0.00
KRW/USD	Verfall 07.12.2022	5'849'857	7'600'000'000		USD/KRW		0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 28.12.2022	930'020	7'000'000		CHF/CNY		0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 13.01.2023	1'266'608	1'700'000		USD/CAD		0.00	0.00
CHF/IDR	Verfall 17.02.2023	1'600'000'000	96'835		IDR/CHF		0.00	0.00
USD/KRW	Verfall 10.03.2023	7'600'000'000	5'875'086		KRW/USD		0.00	0.00
USD/KRW	Verfall 10.03.2023	2'010'000'000	1'614'458		KRW/USD		0.00	0.00
KRW/USD	Verfall 10.03.2023	7'395'482	9'610'000'000		USD/KRW		0.00	0.00
USD/KRW	Verfall 16.06.2023	9'610'000'000	7'437'321		KRW/USD		0.00	0.00
KRW/USD	Verfall 16.06.2023	7'555'732	9'610'000'000		USD/KRW		0.00	0.00
USD/KRW	Verfall 08.09.2023	3'000'000'000	2'370'919		KRW/USD		0.00	0.00
KRW/USD	Verfall 08.09.2023	2'352'015	3'000'000'000		USD/KRW		0.00	0.00

#### Devisentermingeschäfte

**0.00 0.00**

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CNY/CHF	Verfall 01.12.2022	31'069'696	224'000'000		CHF/CNY		0.00	0.00
THB/CHF	Verfall 01.12.2022	2'612'470	100'000'000		CHF/THB		0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 01.12.2022	979'641	10'600'000		CHF/NOK		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 01.12.2022	44'068'496	6'438'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 01.12.2022	1'403'776	16'000'000		CHF/SEK		0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 01.12.2022	4'815'296	7'711'000		CHF/AUD		0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 01.12.2022	12'391'571	11'250'000		CHF/GBP		0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall 01.12.2022	1'427'703	29'050'000		CHF/MXN		0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 01.12.2022	10'478'873	14'600'000		CHF/CAD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	74'176'877	76'700'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	174'600'099	175'900'000		CHF/USD		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	500'000	496'011		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	920'000	911'697		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	500'000	498'716		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	640'000	644'589		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 01.12.2022	100'000	73'029		CAD/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	380'000	378'756		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	850'000	846'178		USD/CHF		0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 01.12.2022	761'972	670'000		CHF/GBP		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	1'436'225	1'450'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	2'997'894	3'000'000		CHF/USD		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	895'420	900'000		CHF/USD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	1'280'422	1'300'000		CHF/EUR		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 01.12.2022	909'853	134'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.12.2022	920'000	908'899		USD/CHF		0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 01.12.2022	621'204	550'000		CHF/GBP		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	581'900	600'000		CHF/USD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	1'074'483	1'100'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	1'992'606	2'100'000		CHF/USD		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	821'299	870'000		CHF/USD		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	413'555	440'000		CHF/USD		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	2'093'659	2'200'000		CHF/USD		0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 01.12.2022	662'544	930'000		CHF/CAD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	1'870'700	1'900'000		CHF/EUR		0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 01.12.2022	618'391	980'000		CHF/AUD		0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 01.12.2022	440'062	620'000		CHF/CAD		0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 01.12.2022	260'000	293'682		GBP/CHF		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	1'052'674	1'100'000		CHF/USD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.12.2022	696'581	710'000		CHF/EUR		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 01.12.2022	1'089'613	160'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 01.12.2022	5'800'000	757'358		CNY/CHF		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.12.2022	1'320'750	1'400'000		CHF/USD		0.00	0.00
KRW/CHF	Verfall 02.12.2022	2'014'029	2'900'000'000		CHF/KRW		0.00	0.00
CHF/KRW	Verfall 02.12.2022	2'900'000'000	2'073'453		KRW/CHF		0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 13.01.2023	28'951'212	218'200'000		CHF/CNY		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 13.01.2023	178'689'766	188'900'000		CHF/USD		0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 13.01.2023	1'440'400	16'000'000		CHF/SEK		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 13.01.2023	83'482'764	84'900'000		CHF/EUR		0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 13.01.2023	1'006'926	10'600'000		CHF/NOK		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 13.01.2023	47'596'452	6'920'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00
THB/CHF	Verfall 13.01.2023	2'685'850	100'000'000		CHF/THB		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.
	CAD/CHF Verfall 13.01.2023		11'366'740	16'300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.01.2023		13'881'854	12'210'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.01.2023		5'659'555	8'900'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 13.01.2023		1'419'749	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		940'000	888'873		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		1'030'000	975'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.01.2023		4'063'166	3'590'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		7'236'594	54'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.01.2023		2'234'341	3'520'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.01.2023		20'666'914	21'090'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.01.2023		3'145'239	4'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.01.2023		11'555'706	1'694'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		44'456'836	46'930'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		799'656	6'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.01.2023		1'005'791	1'020'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		2'151'250	2'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		2'433'865	2'620'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		934'208	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		1'500'000	1'403'609		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		938'966	7'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 13.01.2023		550'000	627'024		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		1'640'301	1'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		1'204'443	9'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		4'100'070	4'410'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.01.2023		3'065'001	3'120'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.01.2023		1'540'004	225'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		1'540'000	1'435'425		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		1'789'382	1'940'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		672'764	730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.01.2023		853'121	126'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.01.2023		950'000	937'612		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.01.2023		1'230'000	1'214'658		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		2'240'000	2'076'668		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 13.01.2023		550'000	618'994		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.01.2023		208'000'000	1'458'908		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		4'000'000	3'699'924		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.01.2023		1'500'000	1'474'364		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		741'828	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		1'480'000	1'374'119		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.01.2023		910'000	895'208		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.01.2023		1'320'000	1'220'120		USD/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 13.01.2023		829'653	31'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		2'890'824	3'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.01.2023		848'675	860'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		668'610	5'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 13.01.2023		861'226	123'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 13.01.2023		680'000	672'247		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 13.01.2023		1'230'000	841'306		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.01.2023		1'685'179	1'710'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 13.01.2023		1'165'138	1'690'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		2'571'148	2'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.01.2023		1'196'099	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 13.01.2023		1'220'283	9'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 13.01.2023		2'061'954	2'900'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 13.01.2023		992'806	1'380'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 13.01.2023		4'280'000'000	3'164'311		KRW/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.02.2023		16'547'276	14'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.02.2023		1'418'304	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.02.2023		62'402'424	8'880'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.02.2023		228'725'199	246'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.02.2023		14'686'089	21'260'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.02.2023		42'274'253	308'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.02.2023		3'653'983	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.02.2023		107'415'497	107'430'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.02.2023		7'957'867	12'420'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.02.2023		985'821	10'600'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.02.2023		1'422'160	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.02.2023		74'000'000	519'634		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.02.2023		1'080'000	745'226		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		2'900'000	2'686'221		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.02.2023		2'698'221	2'970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.02.2023		1'344'277	1'360'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.02.2023		1'999'858	2'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.02.2023		801'241	810'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		1'730'000	1'593'072		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.02.2023		980'000	979'994		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.02.2023		7'800'000	7'762'747		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.02.2023		16'000'000	2'166'112		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.02.2023		671'000'000	4'765'368		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		16'000'000	14'576'576		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.02.2023		680'000	464'995		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.02.2023		1'217'881	1'220'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		1'700'000	1'575'290		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		2'400'000	2'207'566		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.02.2023		400'000	445'351		GBP/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.02.2023		3'151'132	4'280'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 17.02.2023		1'497'717	24'600'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 17.02.2023	23'000'000'000		1'392'159		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.02.2023	4'280'000'000		3'100'384		KRW/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.03.2023		15'973'572	14'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.03.2023		100'666'440	102'040'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 30.03.2023		960'699	10'600'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.03.2023		7'958'699	12'420'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		208'878'001	227'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 30.03.2023		3'564'903	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 30.03.2023		39'360'801	292'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.03.2023		1'423'130	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.03.2023		13'412'217	19'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 30.03.2023		1'419'216	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.03.2023		56'555'334	8'135'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		1'864'547	2'030'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.03.2023		1'600'000	1'475'048		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.03.2023		350'000	346'735		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.03.2023		1'250'000	1'161'829		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 30.03.2023		340'000	232'945		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 30.03.2023		80'000	50'895		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.03.2023		2'060'000	1'901'617		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.03.2023		750'000	738'726		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 30.03.2023		1'250'000	790'634		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		1'296'420	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.03.2023		140'000	157'815		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.03.2023		240'000	238'456		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 30.03.2023		710'000	708'182		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.03.2023		50'000	56'112		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.03.2023		2'340'000	2'200'225		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 30.03.2023		900'000	80'141		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 30.03.2023		4'200'000	370'503		NOK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.03.2023		1'234'630	1'260'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		1'353'376	1'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		2'840'070	3'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 30.03.2023		802'807	117'170'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.03.2023		762'438	780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 31.03.2023		1'476'715	24'600'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.03.2023		3'088'504	4'280'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 31.03.2023		209'895	3'500'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 31.03.2023	28'100'000'000		1'707'366		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.03.2023	4'280'000'000		3'023'607		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		210'338'357	229'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 12.05.2023		6'820'683	11'090'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.05.2023		101'568'314	102'030'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.05.2023		58'120'363	8'252'170'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 12.05.2023		3'514'337	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 12.05.2023		1'444'712	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 12.05.2023		485'854	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 12.05.2023		15'957'465	14'110'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 12.05.2023		1'419'936	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 12.05.2023		12'893'013	19'160'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.05.2023		39'090'516	292'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.05.2023		1'270'000	1'163'245		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 12.05.2023		690'000	683'149		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 12.05.2023		7'300'000	969'644		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		999'539	1'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.05.2023		837'701	850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		1'534'998	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.05.2023		3'230'000	2'875'081		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.05.2023		760'000	680'812		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		2'569'284	2'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		6'451'753	7'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 12.05.2023		2'860'937	2'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 12.05.2023		1'728'935	13'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 12.05.2023		1'309'452	195'810'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		1'273'706	1'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 12.05.2023		1'209'465	1'240'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 15.05.2023		1'694'241	28'100'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.05.2023		3'015'002	4'280'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.05.2023		4'280'000'000	2'874'270		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 15.05.2023		28'100'000'000	1'693'271		IDR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.06.2023		105'428'381	108'330'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		57'290'273	8'647'980'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 23.06.2023		3'457'483	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.06.2023		6'645'572	11'090'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 23.06.2023		1'446'327	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.06.2023		12'694'362	19'160'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.06.2023		15'769'548	14'110'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		215'478'507	243'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 23.06.2023		464'629	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.06.2023		851'200	1'430'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		1'032'999	156'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.06.2023		1'952'568	2'010'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		1'951'288	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.06.2023		1'138'819	1'730'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.06.2023		1'357'484	1'220'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.06.2023		2'200'000	1'963'542		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 23.06.2023		1'530'000	1'480'855		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.06.2023		3'230'000	2'889'351		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.06.2023		2'100'000	1'893'314		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 23.06.2023		340'000	378'935		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		626'975	97'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		1'081'764	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.06.2023		3'171'820	3'260'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		4'608'775	5'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		1'126'548	173'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.06.2023		2'232'395	1'980'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.06.2023		797'280	1'320'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.06.2023		1'435'535	2'130'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		7'460'195	1'150'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		27'989'280	31'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.06.2023		13'161'244	13'570'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.06.2023		1'930'911	1'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.06.2023		7'808'676	1'200'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.06.2023		1'218'218	1'990'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.06.2023		14'159'555	14'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.06.2023		1'133'426	1'670'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		29'679'730	32'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.06.2023		2'740'000	2'482'139		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 26.06.2023		38'170'468	298'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 26.06.2023		1'387'232	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 26.06.2023		1'407'021	11'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 26.06.2023		1'228'320	9'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 26.06.2023		5'426'636	42'900'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 26.06.2023		4'538'230	35'760'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.06.2023		1'676'351	28'100'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.06.2023		2'866'051	4'280'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.06.2023		28'100'000'000	1'685'592		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.06.2023		4'280'000'000	2'974'445		KRW/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		3'362'534	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		274'463'169	307'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		1'336'128	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		137'187'390	140'140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		49'508'544	397'560'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		16'717'722	24'690'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		9'570'517	15'830'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		72'125'267	11'424'880'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		1'498'254	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		459'668	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		21'213'507	18'670'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		1'000'000	893'683		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		2'000'000	1'790'762		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		1'700'000	1'511'485		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.07.2023		1'700'000	1'656'963		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.07.2023		100'000'000	627'095		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'719'352	2'000'000		CHF/USD	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.
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'479'200	1'720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'212'851	1'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 27.07.2023		6'400'000	772'282		CNY/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		4'022'348	5'800'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 28.07.2023		2'027'224	34'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 28.07.2023		34'000'000'000	1'959'654		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.07.2023		5'800'000'000	3'931'537		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.09.2023		47'434'409	391'160'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 11.09.2023		470'239	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.09.2023		137'357'280	144'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 11.09.2023		1'465'523	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 11.09.2023		3'285'808	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.09.2023		9'268'402	15'830'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.09.2023		16'137'409	24'690'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.09.2023		271'440'540	315'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 11.09.2023		1'330'832	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 11.09.2023		71'965'881	11'700'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.09.2023		20'689'217	18'670'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.09.2023		1'417'151	1'280'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.09.2023		1'636'381	1'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		2'420'000	2'115'830		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.09.2023		1'462'284	12'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		1'600'000	1'390'269		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.09.2023		1'000'000	957'860		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		1'960'000	1'714'151		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		960'000	841'271		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.09.2023		930'000	888'272		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.09.2023		2'290'000	2'191'274		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		2'140'000	1'872'078		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 11.09.2023		142'890'000	859'743		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		2'300'000	2'043'849		USD/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 12.09.2023		2'215'280	39'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 12.09.2023		4'391'150	6'500'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 12.09.2023		6'500'000'000	4'344'812		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 12.09.2023		39'000'000'000	2'268'721		IDR/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 19.10.2023		3'279'310	131'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 19.10.2023		16'073'042	24'690'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 19.10.2023		8'988'971	15'830'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.10.2023		268'048'583	301'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 19.10.2023		457'111	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.10.2023		130'456'387	136'780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.10.2023		69'466'375	11'420'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 19.10.2023		1'279'776	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.10.2023		48'723'631	401'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.10.2023		22'137'697	19'950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 19.10.2023		1'462'473	29'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 19.10.2023		4'100'000	497'789		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.10.2023		2'800'000	2'486'728		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.10.2023		164'300'000	999'682		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.10.2023		3'510'000	3'170'429		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 19.10.2023		33'080'000	833'308		THB/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.10.2023		2'839'275	3'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.10.2023		2'080'000	1'911'235		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.10.2023		1'490'000	1'439'964		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 19.10.2023		37'000'000	925'958		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.10.2023		940'000	908'337		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.10.2023		900'000	827'559		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.10.2023		262'200'000	1'622'182		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.10.2023		2'330'000	2'147'337		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.10.2023		1'773'151	1'960'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.10.2023		941'177	990'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 20.10.2023		4'333'082	6'500'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 20.10.2023		2'254'687	39'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 20.10.2023		39'000'000'000	2'236'739		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 20.10.2023		6'500'000'000	4'332'374		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 30.11.2023		14'927'951	22'700'000		CHF/CAD	86'219.07	0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		21'789'669	19'950'000		CHF/GBP	-176'583.72	-0.02	b)
	THB/CHF Verfall 30.11.2023		1'504'042	60'920'000		CHF/THB	-38'084.53	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 30.11.2023		1'316'448	16'000'000		CHF/SEK	15'634.27	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		128'546'203	135'340'000		CHF/EUR	-1'394'755.13	-0.13	b)
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		264'326'657	294'860'000		CHF/USD	-3'189'091.31	-0.30	b)
	AUD/CHF Verfall 30.11.2023		7'999'740	14'000'000		CHF/AUD	-49'883.42	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		48'738'726	397'400'000		CHF/CNY	-476'781.91	-0.05	b)
	NOK/CHF Verfall 30.11.2023		450'857	5'500'000		CHF/NOK	3'785.20	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 30.11.2023		1'441'179	29'050'000		CHF/MXN	-11'955.73	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		65'284'865	10'830'000'000		CHF/JPY	101'629.51	0.01	b)
	CHF/USD Verfall 30.11.2023		2'470'000	2'209'882		USD/CHF	31'053.40	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 30.11.2023		690'000	654'544		EUR/CHF	7'928.76	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 30.11.2023		2'460'000	2'185'211		USD/CHF	46'630.69	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 30.11.2023		150'000	161'547		GBP/CHF	3'609.55	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		1'336'196	1'500'000		CHF/USD	-24'688.43	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 30.11.2023		2'465'780	19'940'000		CHF/CNY	-3'691.50	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		6'230'991	6'490'000		CHF/EUR	-198.03	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 30.11.2023		1'058'578	176'050'000		CHF/JPY	-1'022.02	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		582'078	530'000		CHF/GBP	-1'491.16	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		12'128'983	13'390'000		CHF/USD	-19'446.61	0.00	b)
	IDR/CHF Verfall 01.12.2023		2'218'632	39'000'000'000		CHF/IDR	-6'127.79	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 01.12.2023		4'320'568	6'500'000'000		CHF/KRW	-52'390.31	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>-5'149'701.15</b>	<b>-0.49</b>	

## Swaps

								Kurswert CHF	in % 7)
08/27	IRS FIX LEG 1.5127% P.A. EUR	45'000	0	45'000	0 EUR	0.00%		0.00	0.00
08/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-45'000	45'000	0	0 EUR	0.00		0.00	0.00
03/28	IRS FIX LEG 3.0186% P.A. EUR	0	25'000	25'000	0 EUR	0.00%		0.00	0.00
03/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	0	25'000	25'000	0 EUR	0.00		0.00	0.00
07/33	IRS FIX LEG 0.732% P.A. JPY	0	1'500'000	1'500'000	0 JPY	0.00%		0.00	0.00
07/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	1'500'000	1'500'000	0 JPY	0.00		0.00	0.00
02/53	IRS FIX LEG 2.95024% P.A. USD	0	0	14'000	-14'000 USD	76.21%		-9'709'090.82	-0.92 b)
02/53	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	0	14'000	0	14'000 USD	100.00		12'740'700.00	1.21 b)
								<b>3'031'609.18</b>	<b>0.29</b>

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	12'247'812.13	1.16
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'032'216'769.02	98.16
Derivative Finanzinstrumente	-2'118'091.97	-0.20
Sonstige Vermögenswerte	9'198'209.33	0.87
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'051'544'698.51</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-20'410'707.02	
Andere Verbindlichkeiten	-179'762.74	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'030'954'228.75</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'032'216'769.02	98.16
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'118'091.97	-0.20
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

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

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	66'315'035.72	6.432
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	608'361'299.25	59.010

## 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
ASTT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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



## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.11.2022 - 31.10.2023

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

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

## 8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate ex CHF TR Index Value Unhedged CHF

## 9 TER

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

## 10 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

**Ex-Datum:** 21.02.2024

**Thesaurierung an Anteilscheininhaber**

**Zahlbar:** 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
ASTT CHF 34)	Ja	CHF	1.222	-	1.222
NTH1 CHF	Ja	CHF	1.596	0.558	1.038

## 11 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

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

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

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

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Investment Fund I

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

Zurzeit mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

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

(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

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

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

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

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> 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<sup>bis</sup> 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