

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND VISION RESPONSIBLE CHF

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	2700759	CHF
CT CHF	37845000	CHF
GT CHF	25702790	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, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Bond Vision,

mit dem Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Vision Responsible CHF

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigelegte Jahresrechnung 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 Jahresrechnung“ 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 Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnung 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 einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung**

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes KAG

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	13
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	13
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
8	Pauschale Verwaltungskommission	14
9	Benchmark	14
10	TER	14
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
13	Fussnoten	15
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
15	Pflichtpublikationen	18

# 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	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		109'728'034.40	119'367'996.61	157'131'227.43	183'938'056.20
<b>Klasse AA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		64'614'581.46	69'609'307.67	93'747'753.30	112'327'287.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		66'315.592	74'181.688	88'605.135	106'042.053
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		974.3498	938.3624	1'058.0400	1'059.2700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		971.3293	941.3652	1'057.3000	1'058.2100
Ausschüttung je Anteil		3.75	1.00	-	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.95 %	0.95 %	0.95 %	0.95 %
<b>Klasse CT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		43'405'594.97	48'213'055.22	61'647'467.59	69'853'951.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		458'612.411	530'844.495	603'899.987	685'551.682
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.6455	90.8233	102.0800	101.8900
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		94.3521	91.1139	102.0100	101.7900
Thesaurierung je Anteil		0.79	0.54	0.41	0.46
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'707'857.97	1'545'633.72	1'736'006.54	1'756'817.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		17'800.480	16'799.480	16'799.480	17'044.480
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.9445	92.0049	103.3400	103.0700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.6471	92.2993	103.2600	102.9700
Thesaurierung je Anteil		0.90	0.65	0.52	0.58
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %

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

### Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	3.29 %	-9.38 %	-1.41 %	0.36 %
Klasse CT CHF	3.76 %	-8.97 %	-0.96 %	0.82 %
Klasse GT CHF	4.53 %	-8.57 %	-0.84 %	0.93 %

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.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	1'591'030.37	2'734'330.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	101'972'418.15	108'732'672.50
Strukturierte Produkte	0.00	1'858'682.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	7'087'287.00	6'778'100.00
Derivative Finanzinstrumente	-891'759.31	-1'319'985.85
Sonstige Vermögenswerte	809'356.92	659'391.13
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>110'568'333.13</b>	<b>119'443'190.17</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-773'837.37	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-66'461.36	-75'193.56
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>109'728'034.40</b>	<b>119'367'996.61</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		74'181.688	88'605.135
Ausgegebene Anteile		419.764	505.281
Zurückgenommene Anteile		-8'285.860	-14'928.728
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>66'315.592</b>	<b>74'181.688</b>

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse CT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		530'844.495	603'899.987
Ausgegebene Anteile		13'103.076	6'928.837
Zurückgenommene Anteile		-85'335.160	-79'984.329
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>458'612.411</b>	<b>530'844.495</b>

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'799.480	16'799.480
Ausgegebene Anteile		1'690.000	-
Zurückgenommene Anteile		-689.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>17'800.480</b>	<b>16'799.480</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		119'367'996.61	157'131'227.43
Ausbezahlte Ausschüttung		-71'463.13	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-101'184.81	-85'722.52
Saldo aus dem Anteilverkehr		-14'207'664.07	-21'689'759.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		4'740'349.80	-15'987'748.48
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>109'728'034.40</b>	<b>119'367'996.61</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		23'193.45	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-44.42	-16'323.78
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'180'142.25	1'093'955.61
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		293'249.20	327'915.00
Erträge aus Wertpapierleihe		23'201.93	17'132.05
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'969.48	568.15
<b>Total Ertrag</b>		<b>1'522'711.89</b>	<b>1'423'247.03</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-18.75	-562.92
Reglementarische Vergütungen		-873'756.88	-1'054'420.96
Sonstige Aufwendungen		-88.00	-146.00
Ausrichtung laufende Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-23'779.30	2'268.70
<b>Total Aufwand</b>		<b>-897'642.93</b>	<b>-1'052'861.18</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>625'068.96</b>	<b>370'385.85</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'494'955.51	-825'645.47
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		52'479.55	36'151.06
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-817'407.00</b>	<b>-419'108.56</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		5'557'756.80	-15'568'639.92
<b>Gesamterfolg</b>		<b>4'740'349.80</b>	<b>-15'987'748.48</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	246'534.39	71'397.41
Vortrag des Vorjahres	3'087.95	5'872.23
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>249'622.34</b>	<b>77'269.64</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	248'683.47	74'181.69
Vortrag auf neue Rechnung	938.87	3'087.95
<b>Total</b>	<b>249'622.34</b>	<b>77'269.64</b>
<hr/>		
Klasse CT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	362'427.95	287'938.58
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>362'427.95</b>	<b>287'938.58</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	126'849.78	100'778.50
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	235'578.17	187'160.08
<b>Total</b>	<b>362'427.95</b>	<b>287'938.58</b>
<hr/>		
Klasse GT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	16'106.62	11'049.86
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>16'106.62</b>	<b>11'049.86</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'637.32	3'867.45
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'469.30	7'182.41
<b>Total</b>	<b>16'106.62</b>	<b>11'049.86</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>101'972'418.15</b>	<b>92.23</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>101'972'418.15</b>	<b>92.23</b>	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	695	0	0	695 CHF	103.10%	716'545.00	0.65	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	500	0	0	500 CHF	100.91%	504'550.00	0.46	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	540	0	0	540 CHF	107.85%	582'390.00	0.53	a)
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	1'230	0	0	1'230 CHF	103.05%	1'267'515.00	1.15	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	500	0	0	500 CHF	104.05%	520'250.00	0.47	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'645	0	0	1'645 CHF	100.50%	1'653'225.00	1.50	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	600	0	0	600 CHF	97.30%	583'800.00	0.53	a)
CH0212184037	4.5325 % ALPHSW FLOAT PERP	1'385	0	0	1'385 CHF	96.80%	1'340'680.00	1.21	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	955	0	955	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	735	0	735	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	1'580	0	1'000	580 CHF	99.28%	575'824.00	0.52	a)
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.50%	995'000.00	0.90	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	250	0	0	250 CHF	99.16%	247'900.00	0.22	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.77%	997'700.00	0.90	a)
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.27%	992'700.00	0.90	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	500	0	0	500 CHF	98.39%	491'950.00	0.44	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	755	0	755	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	1'080	0	1'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	1'235	0	1'235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	350	0	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	1'235	0	1'235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	865	0	865	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293343411	0.4000 % WKBSW 0.4 09/15/25	695	0	0	695 CHF	97.25%	675'887.50	0.61	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	715	0	715	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	625	0	625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	695	0	0	695 CHF	96.15%	668'242.50	0.60	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'560	0	0	1'560 CHF	99.35%	1'549'860.00	1.40	a)
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	1'970	0	1'970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	905	0	905	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	1'040	0	1'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	880	0	0	880 CHF	99.01%	871'288.00	0.79	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	830	0	0	830 CHF	92.60%	768'580.00	0.70	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	1'475	0	1'475	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	500	0	0	500 CHF	95.30%	476'500.00	0.43	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	695	0	695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	1'000	0	0	1'000 CHF	87.80%	878'000.00	0.79	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	630	0	0	630 CHF	92.55%	583'065.00	0.53	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	695	0	0	695 CHF	98.49%	684'505.50	0.62	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	695	0	0	695 CHF	96.40%	669'980.00	0.61	a)
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP	1'735	0	0	1'735 CHF	95.50%	1'656'925.00	1.50	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	1'235	0	1'235	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	1'040	0	0	1'040 CHF	98.15%	1'020'760.00	0.92	a)
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'040	0	1'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	1'385	0	1'000	385 CHF	96.25%	370'562.50	0.34	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	96.70%	1'450'500.00	1.31	a)
CH0373476115	1.7000 % SGKNSW 1.7 PERP	1'500	0	0	1'500 CHF	95.70%	1'435'500.00	1.30	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	500	0	0	500 CHF	98.00%	490'000.00	0.44	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'040	0	0	1'040 CHF	94.50%	982'800.00	0.89	a)
CH0379611004	2.2000 % BALHOL 2.2 06/19/48	1'110	0	0	1'110 CHF	94.25%	1'046'175.00	0.95	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	500	0	0	500 CHF	93.25%	466'250.00	0.42	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.00%	940'000.00	0.85	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.45%	487'250.00	0.44	a)
CH0418609621	0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.44	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	500	0	500 CHF	88.25%	441'250.00	0.40	a)
CH0419042566	2.6250 % VONTOB 2 5/8 PERP	300	0	0	300 CHF	99.90%	299'700.00	0.27	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.24%	982'400.00	0.89	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	400	0	0	400 CHF	99.13%	396'520.00	0.36	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.65%	966'500.00	0.87	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	355	0	355	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.65%	926'500.00	0.84	a)
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	76.05%	760'500.00	0.69	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	1'775	0	0	1'775 CHF	95.71%	1'698'852.50	1.54	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.45%	914'500.00	0.83	a)
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	86.00%	860'000.00	0.78	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	700	0	0	700 CHF	83.25%	582'750.00	0.53	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	1'000	0	0	1'000 CHF	88.85%	888'500.00	0.80	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	600	0	0	600 CHF	88.00%	528'000.00	0.48	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	250	0	0	250 CHF	97.23%	243'075.00	0.22	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	92.45%	554'700.00	0.50	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	500	0	0	500 CHF	95.00%	475'000.00	0.43	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.45%	487'250.00	0.44	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	750	0	0	750 CHF	97.60%	732'000.00	0.66	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.15%	485'750.00	0.44	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	500	0	0	500 CHF	95.00%	475'000.00	0.43	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	500	0	0	500 CHF	90.50%	452'500.00	0.41	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	1'000	0	0	1'000 CHF	92.70%	927'000.00	0.84	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	500	0	0	500 CHF	91.10%	455'500.00	0.41	a)
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.82	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	500	0	0	500 CHF	93.85%	469'250.00	0.42	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	800	0	0	800 CHF	90.45%	723'600.00	0.65	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	600	0	0	600 CHF	88.90%	533'400.00	0.48	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	87.85%	878'500.00	0.79	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	500	0	0	500 CHF	91.55%	457'750.00	0.41	a)
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	350	0	0	350 CHF	98.98%	346'439.45	0.31	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.15%	911'500.00	0.82	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.75%	907'500.00	0.82	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	500	0	0	500 CHF	90.65%	453'250.00	0.41	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	93.00%	744'000.00	0.67	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVS 0 1/4 05/18/33	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	92.80%	556'800.00	0.50	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	500	0	0	500 CHF	89.95%	449'750.00	0.41	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	500	0	0	500 CHF	90.45%	452'250.00	0.41	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	500	0	0	500 CHF	87.30%	436'500.00	0.39	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.40%	924'000.00	0.84	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	91.70%	733'600.00	0.66	a)
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.80	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.50%	925'000.00	0.84	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.25%	922'500.00	0.83	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	600	0	0	600 CHF	101.30%	607'800.00	0.55	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.05%	930'500.00	0.84	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	500	0	0	500 CHF	89.05%	445'250.00	0.40	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.00%	890'000.00	0.80	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	85.45%	854'500.00	0.77	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'000	0	0	1'000 CHF	91.05%	910'500.00	0.82	a)
CH1148266195	0.6250 % SYNNVX 0 5/8 08/30/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.55%	895'500.00	0.81	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.82	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	400	0	0	400 CHF	94.20%	376'800.00	0.34	a)
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	500	0	0	500 CHF	89.85%	449'250.00	0.41	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.15%	881'500.00	0.80	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000	0	0	1'000 CHF	85.40%	854'000.00	0.77	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	1'000	0	0	1'000 CHF	84.28%	842'840.00	0.76	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.70%	937'000.00	0.85	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.70%	897'000.00	0.81	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	500	0	0	500 CHF	97.16%	485'800.00	0.44	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	500	0	0	500 CHF	94.50%	472'500.00	0.43	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	0	650 CHF	97.36%	632'840.00	0.57	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	700	0	0	700 CHF	97.81%	684'670.00	0.62	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	400	0	0	400 CHF	95.15%	380'600.00	0.34	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	700	0	0	700 CHF	96.85%	677'950.00	0.61	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	800	0	0	800 CHF	96.00%	768'000.00	0.69	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.15%	485'750.00	0.44	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	275	0	0	275 CHF	97.70%	268'675.00	0.24	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	450	0	0	450 CHF	97.85%	440'325.00	0.40	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.20%	982'000.00	0.89	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	350	0	0	350 CHF	98.15%	343'525.00	0.31	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	600	0	0	600 CHF	100.10%	600'600.00	0.54	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	700	0	0	700 CHF	96.70%	676'900.00	0.61	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	500	0	0	500 CHF	99.35%	496'750.00	0.45	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.70%	503'500.00	0.46	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	500	0	500 CHF	101.05%	505'250.00	0.46	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	500	0	300	200 CHF	101.15%	202'300.00	0.18	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	500	0	500 CHF	100.45%	502'250.00	0.45	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	500	0	500 CHF	101.45%	507'250.00	0.46	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	0	500	0	500 CHF	104.80%	524'000.00	0.47	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	900	0	900 CHF	99.60%	896'400.00	0.81	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.91	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.91	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	325	0	325 CHF	101.00%	328'250.00	0.30	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	0	500	0	500 CHF	101.75%	508'750.00	0.46	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.25%	1'002'500.00	0.91	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	400	0	400 CHF	100.05%	400'200.00	0.36	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.60%	804'800.00	0.73	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	600	0	600 CHF	99.85%	599'100.00	0.54	a)
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	0	500	0	500 CHF	102.10%	510'500.00	0.46	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAVX 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	800	0	800 CHF	102.10%	816'800.00	0.74	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	0	200	0	200 CHF	103.45%	206'900.00	0.19	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	385	0	385 CHF	100.15%	385'577.50	0.35	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	500	0	500 CHF	101.05%	505'250.00	0.46	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	360	0	360 CHF	101.15%	364'140.00	0.33	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	545	0	545 CHF	100.30%	546'635.00	0.49	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	100.10%	600'600.00	0.54	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	500	0	500 CHF	100.75%	503'750.00	0.46	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	100.65%	603'900.00	0.55	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	500	0	500 CHF	101.36%	506'800.00	0.46	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	0	600	0	600 CHF	100.85%	605'100.00	0.55	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	500	0	500 CHF	102.50%	512'500.00	0.46	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	500	0	500 CHF	99.80%	499'000.00	0.45	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	0	500	0	500 CHF	101.30%	506'500.00	0.46	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	500	0	500 CHF	101.15%	505'750.00	0.46	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	750	0	750 CHF	100.25%	751'875.00	0.68	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	500	0	500 CHF	100.25%	501'250.00	0.45	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	500	0	500 CHF	100.50%	502'500.00	0.45	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	450	0	450 CHF	100.60%	452'700.00	0.41	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	0	500	0	500 CHF	99.55%	497'750.00	0.45	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	500	0	500 CHF	100.35%	501'750.00	0.45	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	500	0	500 CHF	99.70%	498'500.00	0.45	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	500	0	500 CHF	100.14%	500'715.00	0.45	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	930	0	930 CHF	100.41%	933'803.70	0.84	a)
<b>CHF</b>							<b>101'972'418.15</b>	<b>92.23</b>	

#### Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

							<b>7'087'287.00</b>	<b>6.41</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>7'087'287.00</b>	<b>6.41</b>	
1U0866336125	SWC (LU) BF RESPONSIBLE COCO NTH CHF	0	26'600	26'600	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
1U1506499356	SWC (LU) BF SUST GLBL HIGH YIELD NTH CHF	0	34'600	34'600	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
1U1637934073	SWC (LU) BF RESPONSIBLE GLBL CRDT OPPS NTH CHF	35'000	0	35'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
1U1637934313	SWC (LU) BF RESPONSIBLE GLOBAL CONVERTIBLE NTH CHF	35'000	0	35'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
1U2108482741	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPS NTH CHF	0	39'000	39'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
1U2364758917	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID NTH CHF	0	42'000	42'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU0866336125	SWC (LU) BF RESPONSIBLE COCO NTH CHF	0	26'600	13'300	13'300 CHF	129.59	1'723'547.00	1.56	a)
LU1506499356	SWC (LU) BF SUST GLBL HIGH YIELD NTH CHF	0	34'600	17'300	17'300 CHF	103.55	1'791'415.00	1.62	a)
LU2108482741	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPS NTH CHF	0	39'000	19'500	19'500 CHF	89.17	1'738'815.00	1.57	a)
LU2364758917	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID NTH CHF	0	42'000	21'000	21'000 CHF	87.31	1'833'510.00	1.66	a)
<b>CHF</b>							<b>7'087'287.00</b>	<b>6.41</b>	

#### Nicht kotierte Wertpapiere

							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Strukturierte Produkte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0473236351	ZKB TRACKER DYN LS BOND F 2025	200	0	200	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

							<b>-891'759.31</b>	<b>-0.81</b>	
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
12/22	EURO-BUND FUTURE DEC22	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	EURO-BOBL FUTURE DEC22	-53	53	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 10YR NOTE (CBT)DEC22	-48	48	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	0	45	45	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	53	53	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR NOTE (CBT)MAR23	0	48	48	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	53	53	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR NOTE (CBT)JUN23	0	48	48	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	33	33	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	0	10	-10 EUR	0.00	0.00	0.00	a)

### Kreditderivate

								307'006.01	0.28
12/24	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/24	10'000	0	0	10'000 EUR	0.95	91'577.29	0.08	a)
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	-1'500	1'500	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.39 12/27	-1'300	1'300	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/27	7'500	0	7'500	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.39 12/27	7'300	0	7'300	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	2'000	0	0	2'000 EUR	5.67	109'747.53	0.10	a)
06/28	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 06/28	0	6'900	6'900	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/28	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/28	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.40 06/28	0	1'200	1'200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/28	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.40 06/28	0	7'500	7'500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/28	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28	0	0	800	-800 USD	1.41	-10'318.57	-0.01	a)
12/28	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28	0	7'200	0	7'200 USD	1.31	86'116.63	0.08	a)
12/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28	0	0	1'300	-1'300 EUR	2.94	-37'050.59	-0.03	a)
12/28	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/28	0	6'900	0	6'900 EUR	1.00	66'933.72	0.06	a)

### Swaps

								-1'198'765.32	-1.08
01/25	IRS FIX LEG -0.3125% P.A. CHF	7'000	0	0	7'000 CHF	96.10%	6'726'974.73	6.08	b)
01/25	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	-7'000	0	0	-7'000 CHF	100.00	-7'000'000.00	-6.33	b)
01/25	IRS FIX LEG -0.285% P.A. CHF	7'000	0	0	7'000 CHF	96.14%	6'729'932.23	6.09	b)
01/25	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	-7'000	0	0	-7'000 CHF	100.00	-7'000'000.00	-6.33	b)
03/27	IRS FIX LEG 0.451% P.A. EUR	7'000	0	0	7'000 EUR	90.33%	6'124'139.50	5.54	b)
03/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-7'000	0	0	-7'000 EUR	100.00	-6'779'811.78	-6.13	b)

### Vermögensaufstellung

		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		1'591'030.37	1.44
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		101'972'418.15	92.23
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		7'087'287.00	6.41
Derivative Finanzinstrumente		-891'759.31	-0.81
Sonstige Vermögenswerte		809'356.92	0.73
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>110'568'333.13</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten		-773'837.37	
Andere Verbindlichkeiten		-66'461.36	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>109'728'034.40</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);	109'366'711.16	98.91
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'198'765.32	-1.08
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

### Ausgeliehene Effekten

		14'854'820.00	13.43
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>			
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	200 CHF	104.05%
CH0373476115	1.7000 % SGKNSW 1.7 PERP	1'500 CHF	95.70%
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	500 CHF	98.00%
CH0379611004	2.2000 % BALHOL 2.2 06/19/48	1'100 CHF	94.25%
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	500 CHF	91.45%

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 30.09.2023 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	1'000 CHF	86.00%	860'000.00	0.78	
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	600 CHF	92.45%	554'700.00	0.50	
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	600 CHF	88.90%	533'400.00	0.48	
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	300 CHF	91.15%	273'450.00	0.25	
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'000 CHF	90.75%	907'500.00	0.82	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	500 CHF	90.45%	452'250.00	0.41	
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.80	
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'000 CHF	89.55%	895'500.00	0.81	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	100 CHF	88.15%	88'150.00	0.08	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000 CHF	85.40%	854'000.00	0.77	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	500 CHF	93.70%	468'500.00	0.42	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	200 CHF	97.36%	194'720.00	0.18	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	500 CHF	97.15%	485'750.00	0.44	
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	390 CHF	99.35%	387'465.00	0.35	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	500 CHF	100.70%	503'500.00	0.46	
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	500 CHF	104.80%	524'000.00	0.47	
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	400 CHF	100.75%	403'000.00	0.36	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.91	
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	400 CHF	100.05%	400'200.00	0.36	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	545 CHF	100.30%	546'635.00	0.49	

### Collateral Accounts

OTC COLLATERAL BV-BFVCHF CHF ZKB	800'000 CHF	800'000.00
----------------------------------	-------------	------------

### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59041192
CAD	1 = CHF	0.67662722
EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
JPY	100 = CHF	0.61303400
USD	1 = CHF	0.91480000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	7'094'753.90	45.175
Bank account	CHF	501.93	0.003
Bond	CHF	6'649'141.71	42.338
Equity	CHF	1'407'906.93	8.965
Index bond	CHF	552'740.41	3.520
Total	CHF	15'705'044.88	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	47'353'121.79	43.155
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	44'743'402.85	40.777
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

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

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	14'854'820.00
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	0.950	1.200	0.750	0.200	4.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	4.000
GT CHF	0.380	0.600	0.280	0.100	4.000

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

## 9 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

**Ex-Datum:** 23.01.2024 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**  
**Zahlbar:** 26.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	3.75000	1.31250	2.43750

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

**Ex-Datum:** 23.01.2024 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**  
**Zahlbar:** 26.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.79027	0.27659	0.51368
GT CHF	Nein	CHF	0.90484	0.31669	0.58815

## 13 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (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 der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und 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 oder 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. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen von Ziff. 3 bis 5 unten.
3.
  - a) Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
  - b) Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit der neuen Markttrendite angepasst.
4. 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.
5. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens 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 im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
6. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar zu einem Nettovermögens-zufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert 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 einem Anstieg der Anzahl Anteile der Teilvermögen führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

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

7. 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 in Prozenten der Ausschüttung 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 Kommissionsätze 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) Bond Vision

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

mit dem Teilvermögen

### Swisscanto (CH) Bond Fund Vision Responsible CHF

(nachfolgend das "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 des Teilvermögens soll in § 8 Ziff. 3 lit. aa des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In der angepassten Bestimmung in § 8 Ziff. 3 lit. aa des Fondsvertrages ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf eine frei konvertierbare Währung lauten, zu den zulässigen Anlagen gehören.

\*\*\*

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, 14. April 2023

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich