

SWISSCANTO (CH) MONEY MARKET FUND RESPONSIBLE OPPORTUNITIES CHF

Jahresbericht per 30.09.2023

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	42724208	CHF
FT CHF	122049506	CHF
MT CHF	52221057	CHF
NT CHF	39462806	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter 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) Investment Fund II,

mit dem Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Money Market Fund Responsible Opportunities 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	14
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	14
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
8	Pauschale Verwaltungskommission	16
9	Benchmark	17
10	TER	17
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	17
12	Fussnoten	17
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18
14	Pflichtpublikationen	20

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
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		926'180'015.85	187'451'341.18	212'560'532.52	157'202'847.45
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		461'917'717.41	108'761'703.97	136'007'385.19	128'596'433.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'146'410.550	1'220'257.961	1'504'402.975	1'407'165.021
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.7553	89.1301	90.4062	91.3869
Thesaurierung je Anteil		0.64	1.00	1.33	1.24
Total Expense Ratio (TER)		0.09 %	0.08 %	0.08 %	0.08 %
Klasse FT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		69'576'649.81			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		688'396.179			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.0707			
Thesaurierung je Anteil		0.67			
Total Expense Ratio (TER)		0.11 %			
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode				9'885.68	9'971.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				100.000	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				98.8568	99.7151
Thesaurierung je Anteil				1.53	0.98
Total Expense Ratio (TER)				0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		394'685'648.63	78'689'637.21	76'543'261.65	28'596'442.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'117'129.649	827'070.846	793'567.501	293'446.648
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.8643	95.1426	96.4546	97.4502
Thesaurierung je Anteil		0.76	1.15	1.50	1.41
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 DT CHF	1.10 %	-0.56 %	-0.67 %	-0.54 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	1.07 %	0.12 %	-	-
Klasse MT CHF (Lancierung 05.02.2020, Schliessung 11.07.2022)	-	-	-0.59 %	-0.39 %
Klasse NT CHF	1.19 %	-0.48 %	-0.59 %	-0.46 %
Benchmark	0.97 %	-0.41 %	-0.82 %	100.00 %
Tracking Error 33)	0.17 %	0.22 %	0.08 %	0.45 %

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 DT CHF	0.13 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	0.10 %
Klasse NT CHF	0.22 %

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)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	50'168'149.90	15'723'056.03
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	872'565'225.87	168'286'400.35
Derivative Finanzinstrumente	-528'503.02	2'316'951.41
Sonstige Vermögenswerte	4'033'060.32	1'131'975.09
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	926'237'933.07	187'458'382.88
Andere Verbindlichkeiten	-57'917.22	-7'041.70
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	926'180'015.85	187'451'341.18

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'220'257.961	1'504'402.975
Ausgegebene Anteile		5'735'857.569	1'225'651.392
Zurückgenommene Anteile		-1'809'704.980	-1'509'796.406
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'146'410.550	1'220'257.961

Klasse FT CHF	von bis	Lancierung 14.10.2022 30.09.2023
Ausgegebene Anteile		1'147'278.323
Zurückgenommene Anteile		-458'882.144
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		688'396.179

Klasse MT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	100.000
Ausgegebene Anteile		-	308'165.033
Zurückgenommene Anteile		-	-308'265.033
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-

Klasse NT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		827'070.846	793'567.501
Ausgegebene Anteile		5'138'873.300	235'428.354
Zurückgenommene Anteile		-1'848'814.497	-201'925.009
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'117'129.649	827'070.846

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		187'451'341.18	212'560'532.52
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'101'036.14	-1'079'602.34
Saldo aus dem Anteilverkehr		729'699'254.86	-21'969'323.23
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		10'130'455.95	-2'060'265.77
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		926'180'015.85	187'451'341.18

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		72'786.06	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-170.95	-124'768.74
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'065'631.00	2'603'272.59
Erträge aus Wertpapierleihe		23'461.45	6'284.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'920'826.09	913'763.33
Total Ertrag		9'082'533.65	3'398'551.53
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-281'712.18	-88'896.94
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'849'408.45	-1'125'958.83
Total Aufwand		-2'131'120.63	-1'214'855.77
Nettoertrag / Verlust		6'951'413.02	2'183'695.76
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-679'845.74	-4'578'815.55
Realisierter Erfolg		6'271'567.28	-2'395'119.79
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'858'888.67	334'854.02
Gesamterfolg		10'130'455.95	-2'060'265.77

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	3'321'107.82	1'230'444.72
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'321'107.82	1'230'444.72
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'162'387.74	430'655.65
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'158'720.08	799'789.07
Total	3'321'107.82	1'230'444.72
<hr/>		
Klasse FT CHF	30.09.2023	
Nettoertrag	461'378.16	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	461'378.16	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	161'482.36	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	299'895.80	
Total	461'378.16	
<hr/>		
Klasse NT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	3'168'927.04	953'251.04
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'168'927.04	953'251.04
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'109'124.46	333'637.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'059'802.58	619'613.18
Total	3'168'927.04	953'251.04

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.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							872'565'225.87	94.21	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							872'565'225.87	94.21	
AU0000KFWHX0	5.0000 % KFW 5 03/19/24 MTN	0	4'687	4'687	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0213205	4.7500 % AFDB 4 3/4 03/06/24 GDIF	0	4'000	0	4'000 AUD	100.14%	2'364'835.90	0.26	a)
AU3CB0259943	3.0000 % CBAAU 3 01/11/24 MTN	0	5'500	0	5'500 AUD	99.59%	3'233'961.51	0.35	a)
AU3FN0040580	4.8833 % QNBK FLOAT 02/01/23 MTN	5'430	0	5'430	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3FN0054177	4.6634 % CS FLOAT 05/26/23 MTN	5'400	0	5'400	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AUD							5'598'797.41	0.60	
CA06415EK460	2.3800 % BNS 2.38 05/01/23	3'500	0	3'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA31430WAD61	3.0560 % CCDJ 3.056 09/11/23 MTN	0	3'000	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA40427HTD57	3.2450 % HSBC 3.245 09/15/23 DPNT	0	3'000	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA780086QC12	2.9490 % RY 2.949 05/01/23 DPNT	0	3'000	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	0	10'000	0	10'000 CAD	98.87%	6'689'813.32	0.72	a)
CA892329BG72	3.0400 % TOYOTA 3.04 07/12/23 MTN	0	3'000	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CAC04575AB92	1.2500 % ATH 1 1/4 04/09/24 MPLE	0	4'500	0	4'500 CAD	97.53%	2'969'645.82	0.32	a)
CAD							9'659'459.14	1.04	
CH0033037679	3.5000 % RABOBK 3 1/2 08/31/23 EMTN	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0114260257	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 06/28/23 514	0	8'750	8'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0116712644	2.0000 % RAIFFS 2 09/21/23	0	11'850	11'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	0	7'000	4'000	3'000 CHF	100.15%	3'004'500.00	0.32	a)
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126183075	2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	0	3'750	3'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0134866992	0.0000 % SWNBK 0 04/11/23	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	0	4'000	0	4'000 CHF	99.94%	3'997'600.00	0.43	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	0	14'450	0	14'450 CHF	100.18%	14'476'010.00	1.56	a)
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	0	10'000	0	10'000 CHF	99.83%	9'983'000.00	1.08	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	0	6'765	0	6'765 CHF	99.57%	6'735'910.50	0.73	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	0	8'500	3'500	5'000 CHF	99.85%	4'992'500.00	0.54	a)
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	0	1'100	0	1'100 CHF	99.53%	1'094'830.00	0.12	a)
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	0	19'000	0	19'000 CHF	99.90%	18'981'000.00	2.05	a)
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	0	10'000	0	10'000 CHF	99.53%	9'953'000.00	1.07	a)
CH0194112071	1.0000 % KBBL 1 10/04/22	7'635	0	7'635	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0196878661	1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23	2'540	0	2'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199544989	3.0000 % MQGAU 3 11/29/22 EMTN	2'940	200	3'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	0	12'000	0	12'000 CHF	99.91%	11'989'200.00	1.29	a)
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	0	11'560	11'560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200252838	1.8750 % LGT 1 7/8 02/08/23	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	0	13'890	0	13'890 CHF	99.76%	13'856'664.00	1.50	a)
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	0	2'230	0	2'230 CHF	99.75%	2'224'425.00	0.24	a)
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMTN	0	8'970	8'970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204477308	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/13/23	2'500	1'400	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0205310904	1.1250 % KBSCHW 1 1/8 02/20/23	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208580693	1.1250 % KBFIB 1 1/8 03/28/23	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208701380	1.1250 % KBBL 1 1/8 03/27/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0209675211	1.6250 % BFCM 1 5/8 04/11/23 EMTN	1'000	300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0210362791	1.5000 % FHZNSW 1 1/2 04/17/23	5'000	7'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588915	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 09/29/23 580	0	13'400	13'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212184078	1.8750 % SLHN VX 1 7/8 06/21/23	4'000	11'000	15'000	0 CHF	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.
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23 EMTN	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224574647	1.5000 % WKBSNW 1 1/2 10/28/22	2'650	4'000	6'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	0	5'500	0	5'500 CHF	99.99%	5'499'450.00	0.59	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	0	21'100	0	21'100 CHF	99.95%	21'089'450.00	2.28	a)
CH0226869060	1.3750 % TESSIN 1 3/8 11/21/22	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	0	5'900	0	5'900 CHF	99.91%	5'894'690.00	0.64	a)
CH0228622384	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/16/23 586	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	0	5'190	0	5'190 CHF	99.86%	5'182'734.00	0.56	a)
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	99.84%	3'993'600.00	0.43	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	0	12'830	0	12'830 CHF	99.88%	12'814'604.00	1.38	a)
CH0236686843	1.3750 % THURBK 1 3/8 08/28/23	0	13'000	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	0	6'625	0	6'625 CHF	99.74%	6'607'775.00	0.71	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	0	2'650	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	0	3'050	1'050	2'000 CHF	100.01%	2'000'200.00	0.22	a)
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	0	8'650	4'000	4'650 CHF	99.50%	4'626'750.00	0.50	a)
CH0244175201	1.2500 % KBFRI 1 1/4 06/03/24	0	5'740	0	5'740 CHF	99.51%	5'711'874.00	0.62	a)
CH0245146185	1.0000 % KBAARG 1 06/19/23	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	0	4'450	0	4'450 CHF	99.56%	4'430'420.00	0.48	a)
CH0246920208	1.1250 % KBLUZE 1 1/8 06/30/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247849992	1.0000 % PSHYPO 1 03/21/23 595	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	0	3'000	0	3'000 CHF	99.82%	2'994'600.00	0.32	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	0	3'000	0	3'000 CHF	99.13%	2'973'900.00	0.32	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	0	14'900	0	14'900 CHF	99.42%	14'813'580.00	1.60	a)
CH0255893056	1.1250 % CABEI 1 1/8 02/24/23	3'000	685	3'685	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	0	8'000	0	8'000 CHF	98.94%	7'915'200.00	0.85	a)
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	0	5'100	0	5'100 CHF	99.07%	5'052'570.00	0.55	a)
CH0262286252	0.6250 % WKBSNW 0 5/8 12/15/23	0	7'000	0	7'000 CHF	99.73%	6'981'100.00	0.75	a)
CH0262883363	0.6250 % ACAFP 0 5/8 09/15/23 EMTN	0	9'230	9'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	0	6'620	0	6'620 CHF	99.93%	6'615'366.00	0.71	a)
CH0266437950	0.3750 % KBLUZE 0 3/8 01/30/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268988174	0.2500 % SCMNFX 0 1/4 04/17/23	4'000	2'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 EMTN	0	8'200	8'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	0	13'000	0	13'000 CHF	99.75%	12'967'500.00	1.40	a)
CH0276237663	0.3000 % GEBNVX 0.3 04/17/23	0	7'590	7'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	16'930	0	16'930 CHF	99.26%	16'804'718.00	1.81	a)
CH0279135310	0.2500 % SGSNVX 0 1/4 05/08/23	0	9'000	9'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	0	13'270	0	13'270 CHF	99.71%	13'231'517.00	1.43	a)
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	3'000	9'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	0	10'105	0	10'105 CHF	98.95%	9'998'897.50	1.08	a)
CH0285849359	0.3750 % PFZENT 0 3/8 08/30/23 465	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0290007134	0.3750 % KBBS 0 3/8 08/10/23	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292086193	0.4500 % CAF 0.45 09/07/23 EMTN	1'650	4'500	6'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292877880	0.3750 % RDSALN 0 3/8 08/21/23 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	0	2'900	0	2'900 CHF	99.94%	2'898'260.00	0.31	a)
CH0297974880	0.2500 % KO 0 1/4 12/22/22	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790115	0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN	0	8'200	0	8'200 CHF	99.75%	8'179'500.00	0.88	a)
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	0	8'300	1'000	7'300 CHF	99.76%	7'282'480.00	0.79	a)
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	0	16'160	0	16'160 CHF	99.72%	16'114'752.00	1.74	a)
CH0306173722	0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 472	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	0	25'320	0	25'320 CHF	99.46%	25'183'272.00	2.72	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	0	12'760	0	12'760 CHF	99.38%	12'680'888.00	1.37	a)
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	0	8'945	0	8'945 CHF	99.57%	8'906'536.50	0.96	a)
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	0	10'400	0	10'400 CHF	99.90%	10'389'600.00	1.12	a)
CH0315593910	0.5500 % BANQUE 0.55 10/11/22 EMTN	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	0	1'185	0	1'185 CHF	98.21%	1'163'788.50	0.13	a)
CH0318407761	0.3500 % MINGNO 0.35 04/05/23 EMTN	4'000	3'800	7'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN	0	9'500	0	9'500 CHF	99.07%	9'411'650.00	1.02	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143170	0.0000 % PSPNSW 0 09/01/23	4'400	7'600	12'000	0 CHF	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.
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	10'000	0	10'000 CHF	98.75%	9'875'000.00	1.07	a)
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	0	4'000	0	4'000 CHF	99.98%	3'999'200.00	0.43	a)
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	0	1'695	0	1'695 CHF	99.92%	1'693'644.00	0.18	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	0	11'950	0	11'950 CHF	98.49%	11'769'555.00	1.27	a)
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	0	5'000	0	5'000 CHF	99.31%	4'965'500.00	0.54	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	0	19'500	0	19'500 CHF	99.39%	19'381'050.00	2.09	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	0	10'000	5'000	5'000 CHF	98.37%	4'918'500.00	0.53	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	0	2'000	0	2'000 CHF	98.70%	1'974'000.00	0.21	a)
CH0362748326	0.1250 % PSYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	14'705	4'000	10'705 CHF	99.19%	10'618'289.50	1.15	a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	0	3'880	0	3'880 CHF	98.90%	3'837'320.00	0.41	a)
CH0373314894	0.1250 % WSTPNZ 0 1/8 12/15/22 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	0	3'850	0	3'850 CHF	98.84%	3'805'340.00	0.41	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	0	11'000	0	11'000 CHF	99.07%	10'897'700.00	1.18	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	0	6'000	0	6'000 CHF	98.66%	5'919'600.00	0.64	a)
CH0391648026	0.3750 % ADCBUH 0 3/8 01/23/23 GMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	0	13'230	0	13'230 CHF	99.08%	13'108'284.00	1.42	a)
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.86%	4'993'000.00	0.54	a)
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.11	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	0	4'750	0	4'750 CHF	98.20%	4'664'500.00	0.50	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	0	15'800	0	15'800 CHF	99.36%	15'698'880.00	1.69	a)
CH0401007346	0.2530 % EIBKOR 0.253 03/06/23 EMTN	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401673980	0.6250 % EBIUH 0 5/8 02/09/23 EMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	0	3'850	0	3'850 CHF	99.29%	3'822'665.00	0.41	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	0	12'430	0	12'430 CHF	99.28%	12'340'504.00	1.33	a)
CH0406415247	0.1250 % PSYPO 0 1/8 04/26/24 658	0	15'200	3'000	12'200 CHF	99.04%	12'082'880.00	1.30	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	98.37%	9'837'000.00	1.06	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	2'500	14'000	6'000	10'500 CHF	99.92%	10'491'600.00	1.13	a)
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	0	13'060	3'000	10'060 CHF	99.64%	10'023'784.00	1.08	a)
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	0	12'225	0	12'225 CHF	98.99%	12'101'527.50	1.31	a)
CH0414510054	0.2500 % SCHPSW 0 1/4 06/05/23 MTN	0	7'950	7'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	0	7'850	0	7'850 CHF	98.93%	7'766'005.00	0.84	a)
CH0416445325	0.3730 % KOROIL 0.373 06/01/23 EMTN	3'000	5'000	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	98.92%	5'935'200.00	0.64	a)
CH0417086078	0.3030 % KDB 0.303 06/14/23 EMTN	1'000	7'000	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040750	0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN	0	4'000	1'000	3'000 CHF	99.48%	2'984'400.00	0.32	a)
CH0419040875	0.1250 % KOWEPW 0 1/8 02/27/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.21%	992'100.00	0.11	a)
CH0419041345	0.0000 % CMBNSW 0 05/19/23	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	0	9'000	0	9'000 CHF	97.84%	8'805'600.00	0.95	a)
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	0	12'230	0	12'230 CHF	98.79%	12'082'017.00	1.30	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	0	12'075	0	12'075 CHF	99.63%	12'030'322.50	1.30	a)
CH0423563540	0.2075 % KORGAS 0.2075 08/02/23 EMTN	3'000	6'440	9'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0426621709	0.1500 % CM 0.15 07/31/23 EMTN	2'000	8'350	10'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0426621717	0.0500 % BMO 0.05 12/30/22 EMTN	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	99.59%	5'975'400.00	0.65	a)
CH0429659623	0.1500 % KORWAT 0.15 09/20/23 EMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761282	0.3225 % FABUH 0.3225 09/27/23 EMTN	1'000	7'755	8'755	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965540	0.6250 % SANSCF 0 5/8 10/24/22 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	99.45%	3'779'100.00	0.41	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	0	7'075	0	7'075 CHF	99.75%	7'057'312.50	0.76	a)
CH0446595602	0.2500 % MBGGR 0 1/4 11/14/22 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.71%	4'985'500.00	0.54	a)
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	0	3'915	0	3'915 CHF	99.27%	3'886'420.50	0.42	a)
CH0459297419	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 11/08/23 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.84%	1'497'600.00	0.16	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	0	3'600	0	3'600 CHF	99.13%	3'568'680.00	0.39	a)
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	0	9'000	0	9'000 CHF	99.15%	8'923'500.00	0.96	a)
CH0463112083	0.2500 % SLHNVX 0 1/4 10/11/23	0	5'000	0	5'000 CHF	99.95%	4'997'500.00	0.54	a)
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	0	20'710	0	20'710 CHF	99.17%	20'538'107.00	2.22	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.
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	98.28%	5'896'800.00	0.64	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.13%	1'962'600.00	0.21	a)
CH0465767793	0.0000 % KORGAS 0 11/28/23	0	15'690	2'000	13'690 CHF	99.67%	13'644'823.00	1.47	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	0	15'000	0	15'000 CHF	98.51%	14'776'500.00	1.60	a)
CH0488506699	0.1250 % NWG 0 1/8 09/13/23 EMTN	5'000	6'400	11'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393371	0.3800 % COMQAT 0.38 10/19/23 EMTN	0	5'200	0	5'200 CHF	99.92%	5'195'840.00	0.56	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	0	1'000	0	1'000 CHF	99.84%	998'400.00	0.11	a)
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	0	10'765	1'500	9'265 CHF	99.19%	9'189'953.50	0.99	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	0	1'720	0	1'720 CHF	99.59%	1'712'948.00	0.18	a)
CH0539032885	0.3500 % GEBNVX 0.35 10/20/22	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0541537996	0.2725 % HENKEL 0.2725 04/28/23 EMTN	2'500	6'820	9'320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	0	6'700	0	6'700 CHF	98.86%	6'623'620.00	0.72	a)
CH1145908047	0.0000 % SWISTB 0 06/27/24 0804	0	5'000	0	5'000 CHF	98.69%	4'934'700.00	0.53	a)
CH1166151881	0.0000 % ROSW 0 11/25/22	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1181991733	0.4400 % UBS 0.44 04/29/24 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	98.95%	5'937'120.00	0.64	a)
CH1193213183	2.0450 % BCSW 2.045 06/26/24	0	10'000	0	10'000 CHF	99.78%	9'977'800.00	1.08	a)
CH1204500693	0.0000 % SWNBK 0 05/22/23	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500768	0.0000 % SWNBK 0 04/24/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500800	0.0000 % SWNBK 0 05/08/23 27	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500883	0.0000 % SWNBK 0 06/05/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500891	0.0000 % SWNBK 0 07/31/23	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500909	0.0000 % SWNBK 0 06/12/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500917	0.0000 % SWNBK 0 10/30/23	0	10'000	0	10'000 CHF	99.87%	9'986'900.00	1.08	a)
CH1204500925	0.0000 % SWNBK 0 06/19/23 28	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500933	0.0000 % SWNBK 0 08/14/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500941	0.0000 % SWNBK 0 06/26/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500966	0.0000 % SWNBK 0 07/03/23 28	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500974	0.0000 % SWNBK 0 08/28/23	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204500982	0.0000 % SWNBK 0 07/10/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501063	0.0000 % SWNBK 0 08/07/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501121	0.0000 % SWNBK 0 08/28/23 28	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501147	0.0000 % SWNBK 0 09/04/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501204	0.0000 % SWNBK 0 09/25/23 28	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501220	0.0000 % SWNBK 0 10/02/23 28	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501410	0.0000 % SWNBK 0 06/12/23 7	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1262684413	2.0500 % UBS 2.05 04/28/24	0	14'000	0	14'000 CHF	99.98%	13'997'760.00	1.51	a)
CHF							806'142'714.00	87.03	
FR0013255858	0.3750 % CAFFIL 0 3/8 05/11/24	0	8'000	0	8'000 EUR	97.86%	7'582'309.04	0.82	a)
FR0013323722	0.6000 % HSBC 0.6 03/20/23 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0606704558	4.5000 % BNP 4 1/2 03/21/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0860584308	3.6250 % MUBAUH 3 5/8 05/30/23 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0918600668	2.5000 % GWOCN 2 1/2 04/18/23	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0969523843	3.2500 % SCGAU 3 1/4 09/11/23 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1421827269	1.3750 % SRENVX 1 3/8 05/27/23	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1717012014	0.5000 % BZLNZ 0 1/2 05/13/23 GMTN	2'750	0	2'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1796257092	0.7500 % CM 0 3/4 03/22/23 DPNT	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1801780583	0.5000 % TOYOTA 0 1/2 04/06/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1837142790	0.7500 % CAF 0 3/4 06/13/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1962595895	0.7500 % ASBBNK 0 3/4 03/13/24 EMTN	0	2'241	0	2'241 EUR	98.48%	2'137'516.59	0.23	a)
XS1979259220	0.3750 % MET 0 3/8 04/09/24	0	12'962	0	12'962 EUR	98.12%	12'318'128.43	1.33	a)
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	0	3'768	0	3'768 EUR	97.95%	3'574'771.06	0.39	a)
XS2002491517	1.0000 % NWG 1 05/28/24 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	97.98%	4'745'093.41	0.51	a)
XS2079723552	0.0500 % DNBNO 0.05 11/14/23 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2190961784	1.8750 % ATH 1 7/8 06/23/23 EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EUR							30'357'818.53	3.28	
XS0422704071	7.5000 % LLOYDS 7 1/2 04/15/24 EMTN	0	6'000	0	6'000 GBP	100.78%	6'751'475.82	0.73	a)
XS0873675846	2.8750 % MET 2 7/8 01/11/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 GBP	96.78%	3'241'951.79	0.35	a)
XS2108460184	1.0000 % NWDIE 1 01/24/23	2'500	0	2'500	0 GBP	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.
XS2192430572	1.5000 % LLOYDS 1 1/2 06/23/23 EMTN	1'000	1'659	2'659	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GBP							9'993'427.61	1.08	
US63859UBG76	0.5500 % NWDIE 0.55 01/22/24 144A	0	10'000	0	10'000 USD	98.36%	8'998'247.24	0.97	a)
US80283LAJ26	4.0000 % SANUK 4 03/13/24	0	2'000	0	2'000 USD	99.19%	1'814'761.94	0.20	a)
USD							10'813'009.18	1.17	
Derivative Finanzinstrumente							-528'503.02	-0.06	

Devisentermingeschäfte

AUD/CHF	Verfall 06.10.2022	3'809'837	5'675'000	CHF/AUD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 06.10.2022	7'770'808	6'840'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 06.10.2022	7'070'518	7'280'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 06.10.2022	3'540'808	505'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 06.10.2022	949'357	1'275'000	CHF/CAD	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 06.10.2022	8'959	15'000	CHF/NZD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 06.10.2022	676'540	700'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 06.10.2022	700'000	668'362	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 06.10.2022	500'000'000	3'361'860	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 06.10.2022	175'000	112'683	AUD/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 03.11.2022	1'347'690	2'015'000	CHF/AUD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.11.2022	1'720'789	1'400'000	CHF/GBP	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.11.2022	2'071'351	1'840'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 03.11.2022	1'353'992	2'100'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.11.2022	926'198	1'275'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.11.2022	7'028'683	7'200'000	CHF/EUR	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 03.11.2022	8'510	15'000	CHF/NZD	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 03.11.2022	103'000	65'929	AUD/CHF	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.11.2022	729'568	1'000'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 01.12.2022	2'028'147	1'650'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 08.12.2022	2'561'016	4'012'000	CHF/AUD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 08.12.2022	3'658'579	3'200'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 08.12.2022	1'662'659	2'275'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.12.2022	7'094'362	7'200'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.12.2022	591'719	600'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.12.2022	493'747	500'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 08.12.2022	633'345	870'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.12.2022	983'877	1'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 08.12.2022	1'885'257	1'650'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 05.01.2023	2'173'041	3'145'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 05.01.2023	9'192'083	9'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 05.01.2023	5'559'841	4'850'000	CHF/GBP	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 05.01.2023	1'580'053	2'500'000	CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 05.01.2023	98'718	100'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 05.01.2023	55'071	80'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 05.01.2023	57'158	50'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 05.01.2023	825'000	520'704	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 05.01.2023	660'000	653'642	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 12.01.2023	2'290'328	2'200'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023	2'350'368	2'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023	8'632'655	8'740'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.02.2023	1'052'091	1'675'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.02.2023	2'214'533	3'225'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023	5'467'758	4'900'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023	2'173'096	2'200'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 02.02.2023	2'050'000	2'300'241	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 02.02.2023	2'500'000	2'843'480	GBP/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.03.2023	1'212'820	1'330'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 02.03.2023	1'330'000	1'254'177	USD/CHF	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.03.2023	2'287'663	3'325'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.03.2023	399'007	350'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.03.2023	13'264'441	13'240'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.03.2023	1'087'269	1'675'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 02.03.2023	3'650'000	2'328'685	AUD/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 06.04.2023	1'352'167	1'330'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 06.04.2023	516'099	500'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 06.04.2023	662'916	650'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 06.04.2023	2'984'886	3'050'000	CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 06.04.2023	1'866'997	2'940'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 06.04.2023	1'975'000	1'241'197	AUD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 06.04.2023	395'124	350'000	CHF/GBP	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.
	EUR/CHF Verfall 06.04.2023		13'152'960	13'240'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.04.2023		2'199'648	3'200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.04.2023		1'625'000	1'610'104		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.04.2023		2'000'000	1'988'774		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.04.2023		3'100'000	3'083'812		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		1'717'540	2'310'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		1'448'794	1'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		2'138'896	2'050'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		1'432'887	1'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.05.2023		2'489'824	3'860'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		1'079'357	1'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		1'431'464	2'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.05.2023		535'337	875'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		2'090'866	3'100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		396'827	350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		11'972'790	12'045'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		2'000'000	1'972'244		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		2'454'483	2'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		1'002'285	1'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		4'050'000	3'965'545		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.06.2023		871'489	880'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.06.2023		1'484'096	1'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.06.2023		751'034	660'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.06.2023		5'829'991	8'910'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.06.2023		389'430	350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.06.2023		14'166'587	14'445'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.06.2023		2'820'791	4'735'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 01.06.2023		6'600'000	4'377'364		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.06.2023		633'253	650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.06.2023		443'433	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 01.06.2023		2'700'000	2'631'585		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.06.2023		2'712'675	3'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		2'003'232	3'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		1'826'448	1'650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		8'901'810	9'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		1'130'253	1'010'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		2'791'472	4'735'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		1'590'485	2'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		3'147'820	3'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		4'861'415	5'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		1'500'000	906'446		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		2'660'000	3'026'152		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		3'500'000	3'413'057		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		1'900'000	1'849'078		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		3'500'000	3'141'758		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.08.2023		3'130'614	3'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 10.08.2023		3'649'876	5'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 10.08.2023		1'934'604	3'235'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 10.08.2023		8'574'350	8'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.08.2023		3'036'463	2'000'000		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		1'486'268	1'525'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		1'484'971	2'100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		1'992'573	3'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.09.2023		1'526'974	2'350'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.09.2023		1'842'973	3'235'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.09.2023		8'533'480	8'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		3'052'151	3'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.10.2023		4'827'973	7'450'000		CHF/CAD	-210'257.34	-0.02	b)
	AUD/CHF Verfall 05.10.2023		1'826'931	3'235'000		CHF/AUD	-82'293.58	-0.01	b)
	USD/CHF Verfall 05.10.2023		3'097'980	3'500'000		CHF/USD	-101'889.63	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 05.10.2023		9'935'359	10'425'000		CHF/EUR	-158'072.78	-0.02	b)
	CHF/CAD Verfall 05.10.2023		3'000'000	1'960'314		CAD/CHF	68'508.00	0.01	b)
	CHF/EUR Verfall 05.10.2023		2'100'000	2'005'036		EUR/CHF	28'174.34	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 05.10.2023		3'200'000	2'151'920		CAD/CHF	12'174.17	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'263'206	1'300'000		CHF/EUR	6'732.51	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		1'300'000	1'270'061		EUR/CHF	-13'576.66	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		10'003'010	9'050'000		CHF/GBP	-68'392.13	-0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'278'498	3'650'000		CHF/AUD	139'413.21	0.02	b)
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'867'933	6'650'000		CHF/USD	-145'636.05	-0.02	b)
	AUD/CHF Verfall 01.02.2024		3'659'227	5'900'000		CHF/AUD	206'779.23	0.02	b)
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		964'559	1'000'000		CHF/EUR	5'511.51	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		2'216'399	3'400'000		CHF/CAD	-49'275.49	-0.01	b)
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		3'168'480	4'950'000		CHF/CAD	-129'620.04	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		1'160'395	1'200'000		CHF/EUR	9'515.39	0.00	b)

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.
	USD/CHF Verfall 07.03.2024		1'294'220	1'500'000		CHF/USD	-53'862.59	-0.01	b)
	CHF/AUD Verfall 07.03.2024		3'300'000	1'954'026		AUD/CHF	-28'842.28	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		5'067'620	5'250'000		CHF/EUR	41'582.10	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		2'874'474	3'000'000		CHF/EUR	2'648.60	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		8'621'523	9'000'000		CHF/EUR	6'064.31	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		2'906'178	4'400'000		CHF/CAD	-17'589.04	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		3'348'405	3'500'000		CHF/EUR	3'701.22	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							-528'503.02	-0.06	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	50'168'149.90	5.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	872'565'225.87	94.21
Derivative Finanzinstrumente	-528'503.02	-0.06
Sonstige Vermögenswerte	4'033'060.32	0.44
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	926'237'933.07	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-57'917.22	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	926'180'015.85	

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);	872'565'225.87	94.21
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-528'503.02	-0.06
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

					Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte					29'175'192.67	3.15
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24		500 CAD	98.87%	334'490.67	0.04
CH0188335365	1.7500 % SCMNXX 1 3/4 07/10/24		500 CHF	99.90%	499'500.00	0.05
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24		500 CHF	99.88%	499'400.00	0.05
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452		1'000 CHF	99.82%	998'200.00	0.11
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN		500 CHF	99.57%	497'850.00	0.05
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN		500 CHF	98.21%	491'050.00	0.05
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491		1'000 CHF	99.39%	993'900.00	0.11
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648		1'000 CHF	99.19%	991'900.00	0.11
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24		2'180 CHF	98.84%	2'154'712.00	0.23
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24		400 CHF	98.66%	394'640.00	0.04
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN		1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.11
CH0398677747	0.3500 % ANZNX 0.35 10/22/24 EMTN		2'500 CHF	98.20%	2'455'000.00	0.27
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN		500 CHF	99.29%	496'450.00	0.05
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN		1'000 CHF	98.92%	989'200.00	0.11
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN		500 CHF	97.84%	489'200.00	0.05
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670		1'000 CHF	98.51%	985'100.00	0.11
CH1145908047	0.0000 % SWISTB 0 06/27/24 0804		5'000 CHF	98.69%	4'934'700.00	0.53
CH1204500917	0.0000 % SWNBK 0 10/30/23		10'000 CHF	99.87%	9'986'900.00	1.08

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
NOK	100 = CHF	8.59705800
NZD	1 = CHF	0.54965758
SEK	100 = CHF	8.42031600
USD	1 = CHF	0.91480000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	21'545'793.65	70.649
Bond	CHF	8'792'879.65	28.832
Equity	CHF	158'421.97	0.519
Total	CHF	30'497'095.27	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	9'436'499.53	1.019
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	75'562'848.40	8.159

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
DT CHF	CHF	-	-	-	-
FT CHF	CHF	-	-	-	-
NT 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	29'175'192.67
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
NT CHF	-	-	-	-	4.000

Periode: 01.10.2022 - 05.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.080	0.500	0.050	0.030	4.000

Periode: 15.10.2022 - 05.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FT CHF	0.100	0.600	0.050	0.050	4.000

Periode: 06.09.2023 - 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
DT CHF	0.110	0.500	0.080	0.030	4.000
FT CHF	0.140	0.600	0.090	0.050	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

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit

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 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
DT CHF	Nein	CHF	0.64532	0.22586	0.41946
FT CHF	Nein	CHF	0.67022	0.23457	0.43565
NT CHF	Nein	CHF	0.76969	0.26939	0.50030

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der 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- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Nettoinventarwertes 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.
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 Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite 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 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. Der Nettoinventarwert eines jeden Teilvermögens wird auf 0.0001 der jeweiligen Rechnungseinheit gerundet.
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 Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe 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 Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) 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 eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund II

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

mit dem Teilvermögen

Swisscanto (CH) Money Market Fund Responsible Opportunities CHF

(nachfolgend "das 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, zu ändern.

Im Fondsvertrag erfolgen Anpassungen bei zwei Risikoverteilungsvorschriften (siehe dazu die nachstehenden Ausführungen dieser Veröffentlichung).

Anpassungen Risikoverteilungsvorschriften

In der bisherigen Bestimmung in § 15 Ziff. 14 des Fondsvertrages ist festgehalten, dass als Emittenten bzw. Garanten im Sinne von § 15 Ziff. 11, 12 und 13 des Fondsvertrages neben den OECD-Staaten zugelassen sind: Europäische Union (EU), Europarat, Council of Europe Development Bank (COE), Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung (Weltbank, IBRD), Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung (EBRD), Europäische Investitionsbank (EIB), Interamerikanische Entwicklungsbank (IADB), Nordic Investment Bank (NIB), Asiatische Entwicklungsbank (ADB), Afrikanische Entwicklungsbank (AfDB), European Company for the Financing of Railroad Rolling Stock (Eurofima), Kreditanstalt für Wiederaufbau (KfW), International Finance Corporation (IFC), European Stability Mechanism (ESM) und European Financial Stability Facility (EFSF) sowie der Kanton Zürich.

Diese Bestimmung soll erweitert werden. Neu sollen ebenfalls die Zentralbanken der OECD-Mitgliedstaaten als Emittenten bzw. Garanten zulässig sein.

Zudem soll eine neue Bestimmung betreffend Investitionen in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten aufgenommen werden (vgl. neue Ziff. 15 in § 15 des Fondsvertrages).

Gemäss dieser Bestimmung soll die in Ziff. 3 von § 15 des Fondsvertrages erwähnte Grenze von 10% auf 35% pro Emittent angehoben werden, wenn die Effekten oder Geldmarktinstrumente von einer der beiden Schweizer Pfandbriefzentralen, d.h. entweder der Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken oder der Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute, begeben oder garantiert werden.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die 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 Anleger und Anlegerinnen 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 des Teilvermögens, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 13. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund II

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

mit dem Teilvermögen

Swisscanto (CH) Money Market Fund Responsible Opportunities CHF

(nachfolgend "das 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, zu ändern.

In der Mitteilung vom 13. Juni 2023 wurde unter anderem ausgeführt, dass die in Ziff. 3 von § 15 des Fondsvertrages erwähnte Grenze von 10% auf 35% pro Emittent angehoben werden kann, wenn die Effekten oder Geldmarktinstrumente von einer der beiden Schweizer Pfandbriefzentralen, d.h. entweder der Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken oder der Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute, begeben oder garantiert werden.

Im Einklang mit dieser Anpassung wird in § 8 Ziff. 3.2 Bst. a des Fondsvertrages entsprechend präzisiert, dass Investitionen in Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte gemäss § 8 Ziff. 1 Bst. a von privaten und öffentlich-rechtlichen Emittenten weltweit (inkl. Obligationen, welche von der Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken oder der Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute begeben oder garantiert werden) zulässig sind.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die 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.

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

Zürich, 21. Juli 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund II

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

mit dem Teilvermögen

Swisscanto (CH) Money Market Fund Responsible Opportunities CHF
(nachfolgend das "Teilvermögen")

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

1 Überblick über die neuen Anteilsklassen

Im Umbrella-Fonds bzw. beim Teilvermögen werden neu die Anteilsklassen QT CHF und VT CHF geschaffen. Zu den Eigenschaften der neuen Anteilsklassen siehe die Ausführungen unter Ziff. 2 nachstehend.

2 Eigenschaften der neuen Anteilsklassen

Anteile der Anteilsklasse QT CHF sind thesaurierende Anteile, bei denen die Beteiligung den folgenden Institutionen der beruflichen Vorsorge (2. Säule) und der gebundenen individuellen Vorsorge 3a vorbehalten ist: Freizügigkeitsstiftungen gemäss dem Bundesgesetz über die Freizügigkeit in der beruflichen Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (Freizügigkeitsgesetz, FZG), Einrichtungen mit dem Zweck der Durchführung der ausserobligatorischen beruflichen Vorsorge gemäss Art. 1e der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) und Vorsorgeeinrichtungen/-formen der Säule 3a gemäss Verordnung über die steuerliche Abzugsberechtigung für Beiträge an anerkannte Vorsorgeformen (BVV 3). Die Anteile werden nur vorgenannten Institutionen angeboten, sofern diese eine individuelle Investitionsvereinbarung oder einen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben (vgl. § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages).

Anteile der Anteilsklasse VT CHF sind thesaurierende Anteile, bei denen die Beteiligung den folgenden Institutionen der beruflichen Vorsorge (2. Säule) und der gebundenen individuellen Vorsorge 3a vorbehalten ist: Freizügigkeitsstiftungen gemäss dem Bundesgesetz über die Freizügigkeit in der beruflichen Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (Freizügigkeitsgesetz, FZG), Einrichtungen mit dem Zweck der Durchführung der ausserobligatorischen beruflichen Vorsorge gemäss Art. 1e der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) und Vorsorgeeinrichtungen/-formen der Säule 3a gemäss Verordnung über die steuerliche Abzugsberechtigung für Beiträge an anerkannte Vorsorgeformen (BVV 3) (vgl. § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages).

Die Anteile der QT CHF Klasse und der VT CHF Klasse werden über ein Depot bei der Depotbank geführt. Die Registrierung als Inhaber des Depots gilt der Depotbank, der Fondsleitung und Dritten gegenüber als Ausweis über die Forderung des Anlegers. Für einen Anleger kann auch dessen Depotstelle (Schweizer Bank, Schweizer Effektenhändlerin, ausländische Bank aus einem OECD-Mitgliedstaat oder Liechtenstein, die in massgeblichem Umfang im Custody-Geschäft tätig ist, oder Verwahrstelle in der Schweiz oder einem OECD-Mitgliedstaat) der Depotbank gegenüber als Deponentin eingetragen werden, sofern die Anteile bei der Depotbank in einem ausschliesslich dem Anleger gewidmeten Depot verbucht werden. Die Depotstelle legt die Identität des Anlegers der Depotbank offen,

bestätigt ihr, dass der Anleger die Voraussetzungen der Anteilsklasse und des Meldeverfahrens erfüllt, und erteilt ihr jede Auskunft, die zu diesem Zweck erforderlich oder nützlich ist. Für die Belange des Meldeverfahrens der Verrechnungssteuer entbindet der Anleger die Depotstelle, die Fondsleitung und die Depotbank vollständig und unwiderruflich von der Geheimhaltungspflicht. Die Anleger stimmen dazu insbesondere einer vollständigen Offenlegung ihrer Beteiligung an der kollektiven Kapitalanlage und namentlichen Bekanntgabe gegenüber der Eidgenössischen Steuerverwaltung (ESTV) und/oder dem Bundesamt für Statistik (BFS) zu (vgl. § 6 Ziff. 6 des Fondsvertrages).

3 Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens des Teilvermögens

Gemäss § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages stellt die Fondsleitung für die Leitung, die Vermögensverwaltung und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit in Bezug auf das Teilvermögen und alle Aufgaben der Depotbank wie die Aufbewahrung des Fondsvermögens, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen in § 4 des Fondsvertrages aufgeführten Aufgaben zulasten der Teilvermögen eine jährliche Pauschalkommission in Rechnung. Die pauschale Verwaltungskommission für die neuen Anteilsklassen können der folgenden Tabelle entnommen werden:

Anteilsklasse	Pauschale Verwaltungskommission
QT CHF	höchstens 0% p.a. Die Fondsleitung wird für die Fondsverwaltung (d.h. die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank) nicht über die pauschale Verwaltungskommission, sondern über eine Vergütung entschädigt, die im Rahmen einer entsprechenden Kooperationsvereinbarung zwischen der Zürcher Kantonalbank und der Swisscanto Fondsleitung AG oder einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe festgelegt wird. Es wird keine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Fondsvermögens erhoben.
VT CHF	höchstens 0.60% p.a.

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

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahresbericht sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich