

# SWISSCANTO (CH) MONEY MARKET FUND RESPONSIBLE OPPORTUNITIES CHF

## Jahresbericht per 30.09.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DT CHF	42724208	CHF
FT CHF	122049506	CHF
MT CHF	52221057	CHF
NT CHF	39462806	CHF
VT CHF	130534016	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, 27. Januar 2025

## 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 2024, 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

#### **Beilagen**

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, 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	16
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	16
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
8	Pauschale Verwaltungskommission	17
9	Benchmark	17
10	TER	17
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

# 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  
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	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'644'266'481.07	926'180'015.85	187'451'341.18	212'560'532.52
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		607'571'780.69	461'917'717.41	108'761'703.97	136'007'385.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'677'350.356	5'146'410.550	1'220'257.961	1'504'402.975
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.9900	89.7553	89.1301	90.4062
Thesaurierung je Anteil		0.61	0.64	1.00	1.33
Total Expense Ratio (TER)		0.11 %	0.09 %	0.08 %	0.08 %
<b>Klasse FT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		125'821'130.77	69'576'649.81		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'228'120.585	688'396.179		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		102.4501	101.0707		
Thesaurierung je Anteil		0.66	0.67		
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.11 %		
<b>Klasse MT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode					9'885.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode					100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)					98.8568
Thesaurierung je Anteil					1.53
Total Expense Ratio (TER)					0.00%
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		898'213'332.56	394'685'648.63	78'689'637.21	76'543'261.65
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'234'980.548	4'117'129.649	827'070.846	793'567.501
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		97.2621	95.8643	95.1426	96.4546
Thesaurierung je Anteil		0.76	0.76	1.15	1.50
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse VT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'660'237.05			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		125'354.302			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.9956			
Thesaurierung je Anteil		0.37			
Total Expense Ratio (TER)		0.25 %			

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



## Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	1.63 %	1.41 %	-0.56 %	-0.67 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	1.60 %	1.38 %	0.12 %	-
Klasse MT CHF (Schliessung 11.07.2022)	-	-	-	-0.59 %
Klasse NT CHF	1.74 %	1.50 %	-0.48 %	-0.59 %
Klasse VT CHF (Lancierung 23.01.2024)	1.00 %	-	-	-
Benchmark	1.44 %	1.34 %	-0.41 %	-0.82 %
Tracking Error 33)	0.15 %	0.14 %	0.22 %	0.08 %

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	0.19 %
Klasse FT CHF (Lancierung 14.10.2022)	0.16 %
Klasse NT CHF	0.30 %
Klasse VT CHF (Lancierung 23.01.2024)	-0.44 %

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)	30.09.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	79'670'240.59	50'168'149.90
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'556'749'228.27	872'565'225.87
Derivative Finanzinstrumente	781'602.31	-528'503.02
Sonstige Vermögenswerte	7'142'799.83	4'033'060.32
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'644'343'871.00</b>	<b>926'237'933.07</b>
Andere Verbindlichkeiten	-77'389.93	-57'917.22
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'644'266'481.07</b>	<b>926'180'015.85</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse DT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'146'410.550	1'220'257.961
Ausgegebene Anteile		8'246'106.336	5'735'857.569
Zurückgenommene Anteile		-6'715'166.530	-1'809'704.980
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>6'677'350.356</b>	<b>5'146'410.550</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	Lancierung 14.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse FT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		688'396.179	-
Ausgegebene Anteile		1'439'603.961	1'147'278.323
Zurückgenommene Anteile		-899'879.555	-458'882.144
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'228'120.585</b>	<b>688'396.179</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'117'129.649	827'070.846
Ausgegebene Anteile		11'467'511.465	5'138'873.300
Zurückgenommene Anteile		-6'349'660.566	-1'848'814.497
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'234'980.548</b>	<b>4'117'129.649</b>

	von bis	Lancierung 23.01.2024 30.09.2024
<b>Klasse VT CHF</b>		
Ausgegebene Anteile		180'087.512
Zurückgenommene Anteile		-54'733.210
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>125'354.302</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		926'180'015.85	187'451'341.18
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'756'704.83	-1'101'036.14
Saldo aus dem Anteilverkehr		697'694'760.44	729'699'254.86
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		23'148'409.61	10'130'455.95
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'644'266'481.07</b>	<b>926'180'015.85</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		431'900.19	72'786.06
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-151.21	-170.95
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		9'362'349.16	4'065'631.00
Erträge aus Wertpapierleihe		54'872.65	23'461.45
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		7'895'551.06	4'920'826.09
<b>Total Ertrag</b>		<b>17'744'521.85</b>	<b>9'082'533.65</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-835'455.19	-281'712.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-4'906'675.66	-1'849'408.45
<b>Total Aufwand</b>		<b>-5'742'130.85</b>	<b>-2'131'120.63</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>12'002'391.00</b>	<b>6'951'413.02</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		8'107'983.92	-679'845.74
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>20'110'374.92</b>	<b>6'271'567.28</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'038'034.69	3'858'888.67
<b>Gesamterfolg</b>		<b>23'148'409.61</b>	<b>10'130'455.95</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse DT CHF</b>	<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag	4'099'628.29	3'321'107.82
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>4'099'628.29</b>	<b>3'321'107.82</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'434'869.90	1'162'387.74
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'664'758.39	2'158'720.08
<b>Total</b>	<b>4'099'628.29</b>	<b>3'321'107.82</b>
<b>Klasse FT CHF</b>	<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag	811'567.93	461'378.16
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>811'567.93</b>	<b>461'378.16</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	284'048.78	161'482.36
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	527'519.15	299'895.80
<b>Total</b>	<b>811'567.93</b>	<b>461'378.16</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag	7'043'998.42	3'168'927.04
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>7'043'998.42</b>	<b>3'168'927.04</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'465'399.45	1'109'124.46
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'578'598.97	2'059'802.58
<b>Total</b>	<b>7'043'998.42</b>	<b>3'168'927.04</b>
<b>Klasse VT CHF</b>	<b>30.09.2024</b>	
Nettoertrag	47'196.36	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>47'196.36</b>	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	47'196.36	
<b>Total</b>	<b>47'196.36</b>	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'556'749'228.27</b>	<b>94.67</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'556'749'228.27</b>	<b>94.67</b>	
AU3CB0213205	4.7500 % AFDB 4 3/4 03/06/24 GDIF	4'000	0	4'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0259943	3.0000 % CBAAU 3 01/11/24 MTN	5'500	0	5'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0267052	1.7500 % DE 1 3/4 10/04/24 MTN	0	8'810	0	8'810 AUD	99.99%	5'154'951.50	0.31	a)
<b>AUD</b>							<b>5'154'951.50</b>	<b>0.31</b>	
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	10'000	0	10'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA89117FNR69	2.4960 % TD 2.496 12/02/24	0	5'000	0	5'000 CAD	99.71%	3'112'852.17	0.19	a)
CAC04575AB92	1.2500 % ATH 1 1/4 04/09/24 MPLE	4'500	0	4'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
<b>CAD</b>							<b>3'112'852.17</b>	<b>0.19</b>	
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	0	5'000	0	5'000 CHF	100.65%	5'032'500.00	0.31	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	0	8'590	0	8'590 CHF	100.84%	8'662'156.00	0.53	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	0	15'075	0	15'075 CHF	101.00%	15'225'750.00	0.93	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	0	57'000	57'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	0	1'770	0	1'770 CHF	100.03%	1'770'531.00	0.11	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	0	17'250	0	17'250 CHF	100.06%	17'260'350.00	1.05	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	4'000	500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	14'450	2'620	17'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/4 02/14/24 564	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	6'765	4'000	10'765	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'100	10'355	11'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMNFX 1 3/4 07/10/24	19'000	10'865	29'865	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	10'000	3'000	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	0	1'020	0	1'020 CHF	99.99%	1'019'898.00	0.06	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	12'000	0	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	0	7'910	0	7'910 CHF	100.23%	7'928'193.00	0.48	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	13'890	1'500	15'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'230	1'000	3'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	0	24'620	0	24'620 CHF	100.15%	24'656'930.00	1.50	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	0	47'140	0	47'140 CHF	100.13%	47'201'282.00	2.87	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	0	6'905	0	6'905 CHF	100.51%	6'940'215.50	0.42	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	0	7'000	0	7'000 CHF	100.69%	7'048'300.00	0.43	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	0	12'385	12'385	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0225071593	1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23	5'500	0	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	21'100	3'090	24'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	5'900	0	5'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	0	2'500	0	2'500 CHF	100.08%	2'502'000.00	0.15	a)
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	5'190	0	5'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	12'830	5'000	17'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	0	5'500	0	5'500 CHF	100.03%	5'501'650.00	0.33	a)
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	6'625	0	6'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	7'445	0	7'445 CHF	100.03%	7'447'233.50	0.45	a)
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	4'650	1'500	6'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244175201	1.2500 % KBFRI 1 1/4 06/03/24	5'740	1'980	7'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	4'450	0	4'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	0	8'580	8'580	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	3'000	1'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	0	1'755	1'755	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	3'000	12'310	15'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	0	4'545	4'545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	14'900	1'000	15'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	0	5'390	0	5'390 CHF	99.99%	5'389'461.00	0.33	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	0	3'810	0	3'810 CHF	100.22%	3'818'382.00	0.23	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	8'000	11'665	19'665	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	0	3'250	0	3'250 CHF	99.95%	3'248'375.00	0.20	a)
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	99.94%	2'998'200.00	0.18	a)
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	5'100	21'520	26'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	0	2'205	0	2'205 CHF	99.90%	2'202'795.00	0.13	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	20'450	0	20'450 CHF	99.96%	20'441'820.00	1.24	a)
CH0262286252	0.6250 % WKBNSW 0 5/8 12/15/23	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	0	24'050	0	24'050 CHF	99.89%	24'023'545.00	1.46	a)
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	6'620	0	6'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	28'740	0	28'740 CHF	99.85%	28'696'890.00	1.75	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	0	36'685	0	36'685 CHF	99.79%	36'607'961.50	2.23	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	0	2'860	0	2'860 CHF	99.65%	2'849'990.00	0.17	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	0	7'990	0	7'990 CHF	99.86%	7'978'814.00	0.49	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	0	1'350	0	1'350 CHF	99.68%	1'345'680.00	0.08	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	0	6'570	0	6'570 CHF	99.88%	6'562'116.00	0.40	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	0	3'280	0	3'280 CHF	99.72%	3'270'816.00	0.20	a)
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	13'000	0	13'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	26'070	0	26'070 CHF	99.76%	26'007'432.00	1.58	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	0	12'970	0	12'970 CHF	99.66%	12'925'902.00	0.79	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	0	5'400	0	5'400 CHF	99.47%	5'371'380.00	0.33	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	16'930	3'550	20'480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	0	6'955	0	6'955 CHF	99.51%	6'920'920.50	0.42	a)
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	13'270	0	13'270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	10'105	6'300	16'405	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	0	18'930	0	18'930 CHF	99.65%	18'863'745.00	1.15	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	0	8'850	0	8'850 CHF	99.66%	8'819'910.00	0.54	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	28'225	16'000	12'225 CHF	99.84%	12'205'440.00	0.74	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCSW 0 5/8 07/02/25	0	2'300	0	2'300 CHF	99.74%	2'294'020.00	0.14	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	0	30'155	0	30'155 CHF	99.74%	30'076'597.00	1.83	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	0	7'450	0	7'450 CHF	99.70%	7'427'650.00	0.45	a)
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	0	2'475	0	2'475 CHF	99.87%	2'471'782.50	0.15	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	0	7'400	7'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790115	0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN	8'200	0	8'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	0	4'855	0	4'855 CHF	99.83%	4'846'746.50	0.29	a)
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	7'300	0	7'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	16'160	0	16'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	25'320	0	25'320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	12'760	6'865	19'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	8'945	3'000	11'945	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	10'400	0	10'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0311427618	0.2000 % WKBNSW 0.2 08/19/24	0	15'835	15'835	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	1'185	4'915	6'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415953	0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN	9'500	2'000	11'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	0	9'700	0	9'700 CHF	99.52%	9'653'440.00	0.59	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	0	5'250	5'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	0	10'560	0	10'560 CHF	99.31%	10'487'136.00	0.64	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	0	14'050	2'000	12'050 CHF	99.95%	12'043'975.00	0.73	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	10'000	16'660	26'660	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	1'695	0	1'695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	3'500	0	3'500 CHF	99.57%	3'484'950.00	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	34'735	0	34'735 CHF	99.83%	34'675'950.50	2.11	a)
CH0346461772	0.3500 % BSANCI 0.35 05/30/25 EMTN	0	4'540	0	4'540 CHF	99.38%	4'511'852.00	0.27	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	11'950	10'795	22'745	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	5'000	600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	0	8'050	0	8'050 CHF	99.69%	8'025'045.00	0.49	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.35%	993'500.00	0.06	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	19'500	7'250	26'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	0	4'600	0	4'600 CHF	99.20%	4'563'200.00	0.28	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	5'000	5'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	32'830	0	32'830 CHF	99.50%	32'665'850.00	1.99	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	2'000	2'165	4'165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	0	1'000	0	1'000 CHF	99.55%	995'500.00	0.06	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	10'705	11'500	22'205	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	0	12'015	0	12'015 CHF	99.51%	11'956'126.50	0.73	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	0	24'420	0	24'420 CHF	99.40%	24'273'480.00	1.48	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	3'880	1'500	5'380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	0	1'240	0	1'240 CHF	99.57%	1'234'668.00	0.08	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	3'850	2'200	6'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	0	17'290	0	17'290 CHF	99.40%	17'186'260.00	1.05	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	11'000	1'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 1/2 10/03/25 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	99.20%	2'976'000.00	0.18	a)
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	0	3'630	0	3'630 CHF	99.80%	3'622'740.00	0.22	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	0	5'410	0	5'410 CHF	99.89%	5'404'049.00	0.33	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	6'000	625	6'625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	0	7'665	0	7'665 CHF	100.34%	7'691'061.00	0.47	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	13'230	4'000	17'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	0	4'320	0	4'320 CHF	99.86%	4'313'952.00	0.26	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	0	11'500	0	11'500 CHF	99.78%	11'474'700.00	0.70	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	10'345	0	10'345 CHF	99.92%	10'336'724.00	0.63	a)
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	1'000	5'875	6'875	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	4'750	8'780	4'750	8'780 CHF	99.95%	8'775'610.00	0.53	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	15'800	770	16'570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	3'850	2'100	5'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	12'430	0	12'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	0	7'815	0	7'815 CHF	99.59%	7'782'958.50	0.47	a)
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	12'200	7'750	19'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	10'000	9'500	0	19'500 CHF	99.98%	19'496'100.00	1.19	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	10'500	0	10'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	10'060	0	10'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	12'225	13'790	26'015	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	0	7'300	0	7'300 CHF	99.45%	7'259'850.00	0.44	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	7'850	0	7'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	6'000	3'070	9'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040750	0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN	3'000	5'575	8'575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	0	6'300	0	6'300 CHF	99.84%	6'289'920.00	0.38	a)
CH0419040875	0.1250 % KOWEPW 0 1/8 02/27/24 EMTN	1'000	500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	0	5'030	670	4'360 CHF	99.37%	4'332'532.00	0.26	a)
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	9'000	17'300	0	26'300 CHF	99.99%	26'297'370.00	1.60	a)
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	12'230	2'000	14'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	12'075	3'000	15'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	0	2'000	0	2'000 CHF	99.43%	1'988'600.00	0.12	a)
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	0	500	0	500 CHF	99.91%	499'550.00	0.03	a)
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	3'800	1'000	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186522	0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN	0	3'100	0	3'100 CHF	99.84%	3'095'040.00	0.19	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	0	12'400	0	12'400 CHF	99.86%	12'382'640.00	0.75	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	7'075	0	7'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	0	12'940	0	12'940 CHF	99.73%	12'905'062.00	0.78	a)
CH0457206800	0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206842	0.0010 % MUNHYO 0.001 02/19/24 EMTN	3'915	0	3'915	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297419	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 11/08/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	0	23'510	0	23'510 CHF	99.84%	23'472'384.00	1.43	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	0	5'210	0	5'210 CHF	99.31%	5'174'051.00	0.31	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	3'600	6'650	10'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	9'000	5'300	14'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112083	0.2500 % SLHNVX 0 1/4 10/11/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	20'710	1'000	21'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	6'000	12'450	0	18'450 CHF	99.99%	18'448'155.00	1.12	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	2'000	9'150	11'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767793	0.0000 % KORGAS 0 11/28/23	13'690	0	13'690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	0	13'490	0	13'490 CHF	99.49%	13'421'201.00	0.82	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	0	28'640	0	28'640 CHF	99.14%	28'393'696.00	1.73	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	15'000	12'225	27'225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	0	21'895	0	21'895 CHF	99.84%	21'859'968.00	1.33	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	0	13'940	0	13'940 CHF	99.75%	13'905'150.00	0.85	a)
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	0	23'935	0	23'935 CHF	99.82%	23'891'917.00	1.45	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	0	20'725	0	20'725 CHF	99.26%	20'571'635.00	1.25	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	0	15'465	0	15'465 CHF	99.35%	15'364'477.50	0.93	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	0	13'690	0	13'690 CHF	99.19%	13'579'111.00	0.83	a)
CH0502393371	0.3800 % COMQAT 0.38 10/19/23 EMTN	5'200	0	5'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	0	6'940	0	6'940 CHF	99.29%	6'890'726.00	0.42	a)
CH0508785737	0.1500 % SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN	0	11'660	0	11'660 CHF	99.77%	11'633'182.00	0.71	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	0	16'115	0	16'115 CHF	99.19%	15'984'468.50	0.97	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	9'265	5'190	14'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	0	10'420	0	10'420 CHF	99.84%	10'403'328.00	0.63	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	0	20'795	0	20'795 CHF	99.63%	20'718'058.50	1.26	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	0	1'000	0	1'000 CHF	99.30%	993'000.00	0.06	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	0	8'325	0	8'325 CHF	99.25%	8'262'562.50	0.50	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	0	11'740	0	11'740 CHF	99.43%	11'673'082.00	0.71	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	99.75%	7'980'000.00	0.49	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	0	26'915	0	26'915 CHF	99.61%	26'810'031.50	1.63	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	0	1'000	0	1'000 CHF	99.28%	992'800.00	0.06	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	99.56%	9'956'000.00	0.61	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	0	19'285	0	19'285 CHF	99.92%	19'269'572.00	1.17	a)
CH0589645149	1.7400 % ZKB 1.74 07/09/24 CD	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589645172	1.4400 % ZKB 1.44 06/28/24 CD	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	6'700	0	6'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145908047	0.0000 % SWISTB 0 06/27/24 0804	5'000	3'100	8'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145908419	0.0000 % SWISTB 0 06/13/24 0841	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145908534	0.0000 % SWISTB 0 09/05/24 0853	0	4'200	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	0	3'835	0	3'835 CHF	99.64%	3'821'194.00	0.23	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	0	26'600	0	26'600 CHF	99.85%	26'560'100.00	1.62	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	0	19'890	0	19'890 CHF	99.60%	19'810'440.00	1.20	a)
CH1181991733	0.4400 % UBS 0.44 04/29/24 EMTN	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	0	14'520	0	14'520 CHF	100.23%	14'553'396.00	0.89	a)
CH1193213183	2.0450 % BCSW 2.045 06/26/24	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.39%	1'505'850.00	0.09	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	0	1'400	0	1'400 CHF	99.92%	1'398'880.00	0.09	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	0	2'260	0	2'260 CHF	99.97%	2'259'322.00	0.14	a)
CH1204500917	0.0000 % SWNBK 0 10/30/23	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501667	0.0000 % SWNBK 0 01/03/24 30	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	0	4'575	0	4'575 CHF	101.05%	4'623'037.50	0.28	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	0	4'200	0	4'200 CHF	101.86%	4'278'120.00	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	5'275	0	5'275 CHF	100.35%	5'293'462.50	0.32	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROIL 2.15 12/19/24	0	1'870	0	1'870 CHF	100.08%	1'871'496.00	0.11	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	11'455	0	11'455 CHF	100.16%	11'473'328.00	0.70	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	0	6'180	0	6'180 CHF	100.01%	6'180'618.00	0.38	a)
CH1258960561	0.0000 % SWNBK 0 01/08/24 28	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960587	0.0000 % SWNBK 0 01/15/24 28	0	45'000	45'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960652	0.0000 % SWNBK 0 02/05/24 28	0	30'000	30'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960678	0.0000 % SWNBK 0 02/12/24 28	0	35'000	35'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960736	0.0000 % SWNBK 0 03/04/24 28	0	52'000	52'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960751	0.0000 % SWNBK 0 03/11/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960769	0.0000 % SWNBK 0 05/06/24 84	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960777	0.0000 % SWNBK 0 03/18/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960785	0.0000 % SWNBK 0 08/05/24 168	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960819	0.0000 % SWNBK 0 04/02/24 29	0	50'000	50'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960843	0.0000 % SWNBK 0 06/03/24 84	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960850	0.0000 % SWNBK 0 04/15/24 28	0	35'000	35'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258960934	0.0000 % SWNBK 0 05/13/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961015	0.0000 % SWNBK 0 06/10/24 28	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961098	0.0000 % SWNBK 0 07/08/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961171	0.0000 % SWNBK 0 08/05/24 28	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961197	0.0000 % SWNBK 0 08/12/24 28	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961213	0.0000 % SWNBK 0 08/19/24 28	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961239	0.0000 % SWNBK 0 08/26/24 28	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961254	0.0000 % SWNBK 0 09/02/24 28	0	45'000	45'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961270	0.0000 % SWNBK 0 09/09/24 28	0	40'000	40'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961296	0.0000 % SWNBK 0 09/16/24 28	0	50'000	50'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961312	0.0000 % SWNBK 0 09/23/24 28	0	90'000	90'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1258961353	0.0000 % SWNBK 0 10/07/24 28	0	40'000	0	40'000 CHF	99.98%	39'992'000.00	2.43	a)
CH1258961395	0.0000 % SWNBK 0 10/21/24 28	0	50'000	0	50'000 CHF	99.95%	49'973'000.00	3.04	a)
CH1258961403	0.0000 % SWNBK 0 12/16/24 84	0	20'000	0	20'000 CHF	99.79%	19'957'000.00	1.21	a)
CH1262684413	2.0500 % UBS 2.05 04/28/24	14'000	0	14'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	5'300	0	5'300 CHF	100.95%	5'350'350.00	0.33	a)
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	0	10'500	2'950	7'550 CHF	100.85%	7'614'175.00	0.46	a)
CH1265890645	2.0550 % BCSW 2.055 10/17/24	0	5'000	0	5'000 CHF	100.03%	5'001'550.00	0.30	a)
CH1265890728	1.7675 % BCSW 1.7675 11/15/24	0	20'000	0	20'000 CHF	100.06%	20'011'400.00	1.22	a)
CH1265890835	1.4225 % BCSW 1.4225 03/28/25	0	15'000	0	15'000 CHF	100.09%	15'012'750.00	0.91	a)
CH1265890876	0.9625 % BCSW 0.9625 10/17/25	0	10'000	0	10'000 CHF	99.98%	9'997'900.00	0.61	a)
FR0014000IY3	1.4473 % BPCEGP FLOAT 09/11/25 EMTN	0	20'000	0	20'000 CHF	99.15%	19'829'800.00	1.21	a)
XS2845708044	1.5500 % QNBK 1.55 06/20/25 EMTN	0	25'000	0	25'000 CHF	100.30%	25'074'750.00	1.52	a)
<b>CHF</b>							<b>1'450'631'227.00</b>	<b>88.22</b>	
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	0	25'000	25'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2XG57	1.3750 % HYN0E 1 3/8 04/14/25	0	5'300	0	5'300 EUR	98.91%	4'935'150.67	0.30	a)
FR0013255858	0.3750 % CAFIL 0 3/8 05/11/24	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013421674	0.0000 % SFILFR 0 05/24/24 EMTN	0	3'800	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25 OAT	0	25'000	12'000	13'000 EUR	98.80%	12'091'868.72	0.74	a)
XS1962595895	0.7500 % ASBBNK 0 3/4 03/13/24 EMTN	2'241	0	2'241	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979259220	0.3750 % MET 0 3/8 04/09/24	12'962	0	12'962	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	3'768	0	3'768	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2002491517	1.0000 % NWG 1 05/28/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2091604715	0.3000 % CB 0.3 12/15/24	0	13'500	0	13'500 EUR	99.31%	12'622'140.09	0.77	a)
<b>EUR</b>							<b>29'649'159.48</b>	<b>1.80</b>	
CH0379268722	2.1250 % UBS 2 1/8 09/12/25	0	5'000	5'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0422704071	7.5000 % LLOYDS 7 1/2 04/15/24 EMTN	6'000	0	6'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	3'000	3'000	6'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2435144956	5.6236 % TOYOTA FLOAT 01/21/25 EMTN	0	10'000	0	10'000 GBP	99.87%	11'299'795.86	0.69	a)
<b>GBP</b>							<b>11'299'795.86</b>	<b>0.69</b>	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	4'000'000	0	4'000'000 JPY	100.00%	23'589'200.00	1.43	a)
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	500	0	500 JPY	99.99%	2'948.41	0.00	a)
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	0	2'000'000	0	2'000'000 JPY	100.00%	11'794'835.89	0.72	a)
JP1741951PB0	0.0000 % JTDB 0 11/20/24 1195	0	1'075'000	0	1'075'000 JPY	99.99%	6'339'026.94	0.39	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1742421Q79	0.0000 % JTDB 0 01/10/25 1242	0	2'000'000	0	2'000'000 JPY	99.98%	11'792'123.13	0.72	a)
<b>JPY</b>							<b>53'518'134.37</b>	<b>3.25</b>	
US22550UAF84	6.6186 % UBS FLOAT 02/21/25 FRN	0	4'000	0	4'000 USD	100.26%	3'383'107.89	0.21	a)
US63859UBG76	0.5500 % NWDIE 0.55 01/22/24 144A	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80283LAJ26	4.0000 % SANUK 4 03/13/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	0	40'000	40'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>USD</b>							<b>3'383'107.89</b>	<b>0.21</b>	
<b>Nicht kotierte Wertpapiere</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Geldmarktpapiere</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2694039699	RABOBK ECD 0 09/17/24D	0	20'000'000	20'000'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>CHF</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>781'602.31</b>	<b>0.05</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	CAD/CHF Verfall 05.10.2023		4'827'973	7'450'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.10.2023		1'826'931	3'235'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.10.2023		3'097'980	3'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.10.2023		9'935'359	10'425'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.10.2023		3'000'000	1'960'314	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.10.2023		2'100'000	2'005'036	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.10.2023		3'200'000	2'151'920	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'263'206	1'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		1'300'000	1'270'061	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		10'003'010	9'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		3'215'212	3'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		838'164	1'250'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		1'879'862	3'235'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		8'026'124	8'325'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		3'300'000	2'976'953	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		2'278'498	3'650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		5'867'933	6'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.01.2024		6'650'000	5'951'211	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 11.01.2024		1'844'387	3'235'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 11.01.2024		7'940'277	8'325'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 11.01.2024		9'847'812	9'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.01.2024		179'007	200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		809'638	1'250'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 11.01.2024		5'000'000	4'783'615	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 11.01.2024		162'677	250'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.02.2024		3'659'227	5'900'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.02.2024		3'917'951	6'885'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.02.2024		953'240	1'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.02.2024		169'698	200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.02.2024		9'775'195	9'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.02.2024		3'088'985	3'325'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 01.02.2024		5'600'000	3'191'782	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		964'559	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		2'216'399	3'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		3'168'480	4'950'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		1'160'395	1'200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.03.2024		1'294'220	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 07.03.2024		3'300'000	1'954'026	AUD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 07.03.2024		4'084'313	7'185'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 07.03.2024		962'711	1'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.03.2024		9'871'242	9'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.03.2024		172'012	200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		3'100'765	3'325'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		5'067'620	5'250'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		2'874'474	3'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		8'621'523	9'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		2'906'178	4'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		12'000'000	11'418'648	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		10'141'439	9'050'000	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		5'302'641	5'525'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		1'502'555	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		6'406'194	9'850'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2024		10'100'000	6'556'193		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2024		2'300'000	2'205'364		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2024		1'700'000	1'487'696		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		3'348'405	3'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.05.2024		3'500'000	3'324'685		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		16'021'632	16'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.05.2024		2'769'822	4'150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.05.2024		10'339'475	9'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		8'512'044	8'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.05.2024		4'150'000	2'759'953		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.05.2024		6'500'000	7'398'521		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.05.2024		3'450'000	3'373'741		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.06.2024		3'609'299	3'780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		1'300'529	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.06.2024		350'000	304'258		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		35'413'189	39'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.06.2024		290'686	325'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.06.2024		2'956'806	2'600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.06.2024		21'245'713	21'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.06.2024		9'000'000	8'837'802		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.07.2024		3'175'286	2'950'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.07.2024		15'951'606	16'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.07.2024		2'956'379	2'600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.07.2024		16'077'212	16'580'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2024		5'000'000	4'841'600		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2024		36'548'393	41'025'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2024		40'100'000	35'717'030		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2024		1'079'994	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.08.2024		6'533'863	5'750'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2024		27'534'563	28'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.08.2024		1'972'261	350'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.08.2024		5'750'000	6'663'704		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.08.2024		15'000'000	14'605'575		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.08.2024		5'000'000	4'868'525		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		7'926'131	8'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		2'053'345	350'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		1'021'475	1'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		2'214'924	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2024		4'777'298	8'500'000		CHF/AUD	-195'530.76	-0.01	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024		3'669'283	650'000'000		CHF/JPY	-164'146.68	-0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 03.10.2024		11'623'999	10'100'000		CHF/GBP	200'016.24	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 03.10.2024		1'697'180	1'750'000		CHF/EUR	50'035.09	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024		23'408'417	3'975'000'000		CHF/JPY	-34'525.56	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.10.2024		3'347'991	3'000'000		CHF/GBP	-45'265.95	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.10.2024		7'987'170	8'500'000		CHF/EUR	-13'234.47	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.10.2024		1'018'356	1'200'000		CHF/USD	6'445.59	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.10.2024		2'226'454	2'000'000		CHF/GBP	-35'717.02	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024		1'809'386	310'000'000		CHF/JPY	-18'867.55	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024		3'903'718	650'000'000		CHF/JPY	70'276.99	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 03.10.2024		5'200'000	5'849'719		GBP/CHF	31'928.54	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 03.10.2024		4'000'000	3'773'860		EUR/CHF	-8'963.25	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 20.11.2024		6'357'066	1'075'000'000		CHF/JPY	9'909.52	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 05.12.2024		3'017	500'000		CHF/JPY	63.54	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 05.12.2024		3'056'649	4'900'000		CHF/CAD	13'573.46	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 05.12.2024		3'324'489	3'450'000		CHF/EUR	90'619.56	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 05.12.2024		9'563'747	9'900'000		CHF/EUR	283'909.23	0.02	b)
	JPY/CHF Verfall 05.12.2024		5'896'530	1'000'000'000		CHF/JPY	-9'735.98	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 09.01.2025		8'124'678	1'350'000'000		CHF/JPY	145'185.85	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 06.02.2025		2'155'245	2'550'000		CHF/USD	32'708.34	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 06.02.2025		15'259'184	16'000'000		CHF/EUR	323'176.92	0.02	b)
	CHF/EUR Verfall 06.02.2025		8'000'000	7'480'776		EUR/CHF	-13'195.86	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.04.2025		3'353'256	3'500'000		CHF/EUR	95'360.50	0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 07.08.2025		3'208'056	3'000'000		CHF/GBP	-75'705.02	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 07.08.2025		3'000'000	3'240'693		GBP/CHF	43'281.04	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>781'602.31</b>	<b>0.05</b>	

<b>Vermögensaufstellung</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
Bankguthaben auf Sicht		79'670'240.59	4.85
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		1'556'749'228.27	94.67
Derivative Finanzinstrumente		781'602.31	0.05
Sonstige Vermögenswerte		7'142'799.83	0.43
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'644'343'871.00</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten		-77'389.93	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'644'266'481.07</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'556'749'228.27	94.67
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	781'602.31	0.05
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**

<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>		<b>70'310'505.22</b>	<b>4.28</b>
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	500 CHF	100.08%
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	5'000 CHF	100.03%
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	2'500 CHF	99.47%
CH0284915896	0.6250 % KBSCHEW 0 5/8 07/02/25	1'100 CHF	99.74%
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	6'700 CHF	99.52%
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'000 CHF	99.50%
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	35 CHF	99.51%
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	18'000 CHF	99.98%
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	500 CHF	99.14%
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	500 CHF	99.43%
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	7'000 CHF	99.75%
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	500 CHF	99.61%
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	2'000 CHF	99.64%
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	11'455 CHF	100.16%
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	500 CHF	100.85%
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25 OAT	13'000 EUR	98.80%

### **OTC Gegenparteien**

Cooperatieve Rabobank UA

Zürcher Kantonalbank

### **Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler**

Zürcher Kantonalbank

### **Devisenkurse**

AUD	1 = CHF	0.58521281
CAD	1 = CHF	0.62441245
EUR	1 = CHF	0.94144104
GBP	1 = CHF	1.13149579
JPY	100 = CHF	0.58973000
NOK	100 = CHF	8.00890600
NZD	1 = CHF	0.53670869
SEK	100 = CHF	8.32182400
USD	1 = CHF	0.84355000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	18'516'155.25	24.458
Bond	CHF	57'188'700.85	75.542
Total	CHF	75'704'856.10	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	20'575'557.96	1.251
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	125'391'046.68	7.626

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

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

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	-	-	-	-
VT 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	70'310'505.22
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:** 01.10.2023 - 30.09.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.110	0.500	0.080	0.030	4.000
FT CHF	0.140	0.600	0.090	0.050	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

**Periode:** 23.01.2024 - 30.09.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
VT CHF	0.250	0.600	0.200	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 2023 / 2024

Ex-Datum: 15.01.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.01.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	0.61396	0.21488	0.39908
FT CHF	Nein	CHF	0.66082	0.23128	0.42954
NT CHF	Nein	CHF	0.76275	0.26696	0.49579
VT CHF 34)	Nein	CHF	0.37650	-	0.37650

## 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:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

erkehrswert 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) 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

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<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, 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

## **Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger**

des

### **Swisscanto (CH) Investment Fund II**

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

betrifft das Teilvermögen

### **Swisscanto (CH) Money Market Fund Responsible Opportunities CHF**

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

### **Anpassungen in der Nachhaltigkeitspolitik**

Nebst formellen Änderungen wird im Fondsvertrag ein Hinweis auf das auf Institutsebene nach Massgabe interner Konzepte zur Anwendung gelangende Stewardship (Voting & Engagement) aufgenommen, vgl. § 8 Ziff. 3.10 des Fondsvertrages.

\*\*\*

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, der Jahres- und Halbjahresbericht des Teilvermögens, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. September 2024

#### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich