

# SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE BALANCE

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	237927	CHF
CT CHF	37873490	CHF
NT CHF	125147660	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Relax
- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Select
- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Balance
- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Ambition
- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Focus

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

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



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	29
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	29
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	29
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	30
8	Pauschale Verwaltungskommission	30
9	Benchmark	30
10	TER	31
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	31
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	31
13	Fussnoten	31
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	32
15	Pflichtpublikationen	34

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		781'430'657.56	733'792'558.67	861'313'036.93	695'603'049.39
<b>Klasse AA CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		752'671'871.07	713'565'999.31	836'259'369.38	673'133'315.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		523'048.139	517'035.784	512'705.070	454'236.524
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		1'439.0107	1'380.1095	1'631.0700	1'481.9000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		1'441.4570	1'382.4557	1'631.8900	1'483.6800
Ausschüttung je Anteil		7.25	4.35	3.00	3.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.41 %	1.40 %	1.42 %	1.45 %
<b>Klasse CT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'278'628.49	20'226'559.36	25'053'667.55	22'469'733.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		208'756.005	208'104.036	219'298.516	217'695.040
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		101.9306	97.1945	114.2400	103.2200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		102.1039	97.3597	114.3000	103.3400
Thesaurierung je Anteil		1.14	0.99	0.89	0.86
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.79 %	0.78 %	0.80 %	0.83 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'480'158.00			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		74'588.684			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.2854			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.4559			
Thesaurierung je Anteil		1.41			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.06 %			

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

#### Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	4.58 %	-14.88 %	6.91 %	3.74 %
Klasse CT CHF	5.23 %	-14.34 %	7.58 %	4.38 %
Klasse NT CHF (Lancierung 06.03.2023)	0.46 %	-	-	-

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



## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	5'206'323.64	21'645'078.72
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	320'286'153.37	305'458'270.85
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	265'873'649.05	253'006'532.12
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	187'913'250.75	152'232'711.45
Andere Anlagen - Metallkonten	1'711.13	0.00
Derivative Finanzinstrumente	-282'248.62	-742'867.95
Sonstige Vermögenswerte	3'287'977.48	3'183'497.12
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>782'286'816.80</b>	<b>734'783'222.31</b>
Andere Verbindlichkeiten	-856'159.24	-990'663.64
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>781'430'657.56</b>	<b>733'792'558.67</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		517'035.784	512'705.070
Ausgegebene Anteile		45'947.903	84'179.487
Zurückgenommene Anteile		-39'935.548	-79'848.773
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>523'048.139</b>	<b>517'035.784</b>

Klasse CT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		208'104.036	219'298.516
Ausgegebene Anteile		34'997.554	24'513.590
Zurückgenommene Anteile		-34'345.585	-35'708.070
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>208'756.005</b>	<b>208'104.036</b>

Klasse NT CHF	von bis	Lancierung 06.03.2023 30.09.2023
Ausgegebene Anteile		74'588.684
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>74'588.684</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		733'792'558.67	861'313'036.93
Ausbezahlte Ausschüttung		-2'258'355.66	-1'594'559.38
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-70'591.41	-67'885.52
Saldo aus dem Anteilverkehr		16'305'393.07	10'201'103.32
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		33'661'652.89	-136'059'136.68
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>781'430'657.56</b>	<b>733'792'558.67</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		130'844.54	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-3'910.08	-153'898.31
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		7'019'249.84	7'401'383.73
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'846'980.72	2'831'423.86
Erträge der Gratisaktien		337.28	26'200.39
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		4'245'091.68	3'676'768.54
Erträge aus Wertpapierleihe		103'850.90	107'699.60
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		106'884.59	17'351.70
<b>Total Ertrag</b>		<b>14'449'329.47</b>	<b>13'906'929.51</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-1'019.34	-2'319.19
Reglementarische Vergütungen		-10'231'378.58	-11'386'703.07
Sonstige Aufwendungen		-782.03	-6'794.79
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-72'604.35	-111'364.95
<b>Total Aufwand</b>		<b>-10'305'784.30</b>	<b>-11'507'182.00</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>4'143'545.17</b>	<b>2'399'747.51</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-17'105'570.85	5'346'803.34
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		320'749.93	377'687.72
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		110'575.94	133'026.14
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-12'530'699.81</b>	<b>8'257'264.71</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		46'192'352.70	-144'316'401.39
<b>Gesamterfolg</b>		<b>33'661'652.89</b>	<b>-136'059'136.68</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	3'799'640.74	2'192'884.94
Vortrag des Vorjahres	8'479.38	64'700.10
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'808'120.12</b>	<b>2'257'585.04</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	3'792'099.01	2'249'105.66
Vortrag auf neue Rechnung	16'021.11	8'479.38
<b>Total</b>	<b>3'808'120.12</b>	<b>2'257'585.04</b>
<hr/>		
Klasse CT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	238'445.37	206'862.57
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>238'445.37</b>	<b>206'862.57</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	83'455.88	72'401.90
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	154'989.49	134'460.67
<b>Total</b>	<b>238'445.37</b>	<b>206'862.57</b>
<hr/>		
Klasse NT CHF	30.09.2023	
Nettoertrag	105'459.06	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>105'459.06</b>	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	36'910.67	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	68'548.39	
<b>Total</b>	<b>105'459.06</b>	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>640'475'814.47</b>	<b>81.87</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>320'286'153.37</b>	<b>40.94</b>	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	459	125	139	445 USD	1'267.88	516'136.20	0.07	a)
<b>AR</b>							<b>516'136.20</b>	<b>0.07</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	3'325	5'218	3'325	5'218 EUR	32.82	165'867.86	0.02	a)
AT0000743059	OMV AG	0	2'748	2'748	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT0000746409	VERBUND AG	0	2'092	2'092	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>AT</b>							<b>165'867.86</b>	<b>0.02</b>	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	17'623	22'458	10'426	29'655 AUD	40.85	715'228.99	0.09	a)
AU000000APA1	APA GROUP	50'752	104'899	111'779	43'872 AUD	8.30	214'991.18	0.03	a)
AU000000BHP4	BHP GROUP LTD	0	59'028	59'028	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BXB1	BRAMBLES LTD	0	74'343	74'343	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000DXS1	DEXUS/AU	0	70'694	70'694	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE METALS GROUP LTD	0	24'291	24'291	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000GPT8	GPT GROUP	0	113'995	21'137	92'858 AUD	3.90	213'815.43	0.03	a)
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	0	36'709	0	36'709 AUD	5.68	123'105.09	0.02	a)
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	12'153	3'361	15'514	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000PLS0	PILBARA MINERALS LTD	0	83'950	83'950	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	83'538	46'110	43'702	85'946 AUD	15.71	797'181.06	0.10	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	316'276	316'276	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	0	9'645	0	9'645 AUD	29.80	169'696.78	0.02	a)
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	0	43'204	0	43'204 AUD	13.97	356'348.95	0.05	a)
AU000000TSL2	TELSTRA GROUP LTD	163'145	298'891	462'036	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	23'826	10'842	34'668	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000030678	COLES GROUP LTD	24'800	67'365	92'165	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	0	115'151	0	115'151 AUD	5.27	358'288.98	0.05	a)
AU0000219529	LOTTERY CORP LTD/THE	0	34'513	34'513	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	18'497	52'006	34'295	36'208 AUD	36.49	780'069.89	0.10	a)
AU0000245342	TELSTRA GROUP LTD	0	163'145	163'145	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
<b>AU</b>							<b>3'728'726.35</b>	<b>0.48</b>	
BE0003565737	KBC GROUP NV	7'260	9'336	9'365	7'231 EUR	59.14	414'189.68	0.05	a)
BE0003739530	UCB SA	1'570	1'973	3'543	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	0	15'812	11'867	3'945 EUR	52.51	200'635.89	0.03	a)
<b>BE</b>							<b>614'825.57</b>	<b>0.08</b>	
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	863	1'767	2'630	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>BM</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	48'178	34'683	74'804	8'057 CAD	21.68	118'190.37	0.02	a)
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	0	7'117	7'117	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	0	39'167	0	39'167 CAD	8.04	213'071.72	0.03	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	16'846	7'343	24'189	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15'325	11'489	26'814	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	0	9'912	9'912	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1'231	3'147	4'378	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13'389	30'551	20'830	23'110 CAD	28.70	448'777.74	0.06	a)
CA2861812014	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	0	22'783	22'783	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	0	6'129	6'129	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	778	7'648	5'188	3'238 CAD	181.33	397'279.33	0.05	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	14'582	10'737	25'319	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	24'751	12'695	37'446	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	0	10'936	0	10'936 CAD	85.20	630'445.52	0.08	a)
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	7'513	7'253	14'766	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	7'379	783	8'162	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	80'126	32'884	47'242 CAD	24.82	793'376.84	0.10	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.
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	2'056	15'294	6'681	10'669	CAD	90.23	651'364.58	0.08 a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	0	57'370	20'189	37'181	CAD	22.12	556'487.81	0.07 a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	5'028	6'269	6'422	4'875	CAD	83.88	276'683.02	0.04 a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	0	10'279	6'282	3'997	CAD	20.37	55'090.24	0.01 a)
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	2'706	27'421	14'216	15'911	CAD	47.67	513'206.43	0.07 a)
CA70137W1086	PARKLAND CORP	0	9'934	0	9'934	CAD	39.73	267'049.76	0.03 a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	25'166	10'179	25'166	10'179	CAD	34.58	238'165.89	0.03 a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	0	14'186	14'186	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	15'404	5'455	9'949	CAD	66.27	446'114.01	0.06 a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	0	26'740	0	26'740	CAD	46.71	845'124.58	0.11 a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	0	7'179	7'179	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA8849037095	THOMSON REUTERS CORP	2'222	0	2'222	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	0	4'739	0	4'739	CAD	81.83	262'390.87	0.03 a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2'987	0	2'987	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	5'733	474	6'207	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	0	14'863	14'863	0	CAD	0.00	0.00	0.00
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	0	695	695	0	USD	0.00	0.00	0.00
<b>CA</b>								<b>6'712'818.71</b>	<b>0.86</b>
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	1'718	3'057	1'718	3'057	CHF	544.20	1'663'619.40	0.21 a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	324	709	19	1'014	CHF	2'994.00	3'035'916.00	0.39 a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18'379	1'356	1'220	18'515	CHF	420.10	7'778'151.50	0.99 a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	229'547	0	33'918	195'629	CHF	93.87	18'363'694.23	2.35 a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	75'594	2'258	1'425	76'427	CHF	250.45	19'141'142.15	2.45 a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	38'710	0	692	38'018	CHF	58.78	2'234'698.04	0.29 a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	150'961	54'955	70'312	135'604	CHF	32.80	4'447'811.20	0.57 a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	8'479	3'132	6'645	4'966	CHF	217.70	1'081'098.20	0.14 a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	11'168	964	222	11'910	CHF	425.60	5'068'896.00	0.65 a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2'018	3'583	0	5'601	CHF	571.60	3'201'531.60	0.41 a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3'212	200	62	3'350	CHF	1'034.50	3'465'575.00	0.44 a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	48'261	0	48'261	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	2'603	0	965	1'638	CHF	459.00	751'842.00	0.10 a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	300'198	7'026	14'670	292'554	CHF	103.74	30'349'551.96	3.88 a)
CH0114405324	GARMIN LTD	5'235	0	5'235	0	USD	0.00	0.00	0.00
CH0126881561	SWISS RE AG	16'985	5'208	10'318	11'875	CHF	94.32	1'120'050.00	0.14 a)
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	0	14'773	14'773	0	GBP	0.00	0.00	0.00
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	58'040	4'899	4'366	58'573	CHF	112.00	6'560'176.00	0.84 a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	399'474	0	93'650	305'824	CHF	22.69	6'939'146.56	0.89 a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	9'450	1'312	197	10'565	CHF	233.10	2'462'701.50	0.31 a)
CH0432492467	ALCON INC	60'751	26'889	1'601	86'039	CHF	70.94	6'103'606.66	0.78 a)
CH1169360919	ACCELLERON INDUSTRIES AG	0	7'548	7'548	0	CHF	0.00	0.00	0.00
<b>CH</b>								<b>123'769'208.00</b>	<b>15.82</b>
US36118L1061	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1'588	2'611	4'199	0	USD	0.00	0.00	0.00
<b>CN</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	0	11'100	11'100	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	37'944	30'097	33'327	34'714	EUR	10.45	351'350.48	0.04 a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	0	9'206	9'206	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0005200000	BEIERSDORF AG	0	3'811	3'811	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	5'550	5'550	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	0	15'373	5'002	10'371	EUR	67.46	677'620.55	0.09 a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	0	3'670	3'670	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0006599905	MERCK KGAA	401	5'694	2'960	3'135	EUR	158.15	480'204.63	0.06 a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	23'352	14'995	8'357	EUR	34.96	282'970.67	0.04 a)
DE0006969603	PUMA SE	5'432	0	5'432	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	0	5'932	5'932	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0007164600	SAP SE	9'887	7'650	12'319	5'218	EUR	122.82	620'715.75	0.08 a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	9'326	3'320	4'502	8'144	EUR	135.66	1'070'062.57	0.14 a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	5'509	518	6'027	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	2'640	4'667	2'640	4'667	EUR	166.62	753'155.29	0.10 a)
DE000ENAG999	E.ON SE	0	105'906	53'543	52'363	EUR	11.20	568'018.05	0.07 a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	5'152	8'594	13'746	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	0	1'869	1'869	0	EUR	0.00	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000SYM9999	SYMRISE AG	2'018	0	2'018	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>DE</b>							<b>4'804'097.99</b>	<b>0.61</b>	
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0	63	63	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060079531	DSV A/S	0	634	634	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	9'385	3'190	6'832	5'743 DKK	731.60	545'718.45	0.07	a)
DK0060336014	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2'021	16'216	13'587	4'650 DKK	284.70	171'947.77	0.02	a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	0	1'057	1'057	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	3'524	8'144	11'668	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	16'014	0	16'014	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	18'016	2'495	15'521 DKK	643.90	1'298'058.45	0.17	a)
<b>DK</b>							<b>2'015'724.67</b>	<b>0.26</b>	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	0	8'613	0	8'613 EUR	57.28	477'834.01	0.06	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	43'016	61'480	72'623	31'873 EUR	7.71	238'010.94	0.03	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	3'200	1'916	3'200	1'916 EUR	120.70	223'986.77	0.03	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	0	21'863	6'433	15'430 EUR	35.29	527'396.43	0.07	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	28'582	40'006	68'588	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>ES</b>							<b>1'467'228.15</b>	<b>0.19</b>	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	25'499	23'129	48'628	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009000681	NOKIA OYJ	0	130'300	130'300	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	0	15'408	15'408	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009007884	ELISA OYJ	0	7'947	1'959	5'988 EUR	43.89	254'546.41	0.03	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	0	5'878	0	5'878 EUR	37.22	211'897.36	0.03	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	0	132'231	108'140	24'091 SEK	120.12	243'668.02	0.03	a)
<b>FI</b>							<b>710'111.79</b>	<b>0.09</b>	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	35'259	18'203	53'462	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	0	210	210	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	0	23'059	16'798	6'261 EUR	62.31	377'851.41	0.05	a)
FR0000120321	L'OREAL	0	1'092	1'092	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120578	SANOFI	0	5'327	0	5'327 EUR	101.48	523'579.64	0.07	a)
FR0000120628	AXA SA	31'823	18'537	16'316	34'044 EUR	28.18	929'182.81	0.12	a)
FR0000120644	DANONE	3'340	25'526	15'377	13'489 EUR	52.26	682'761.08	0.09	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	0	10'198	10'198	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	239	645	410	474 EUR	716.40	328'892.16	0.04	a)
FR0000121220	SODEXO SA	0	1'203	0	1'203 EUR	97.52	113'626.31	0.01	a)
FR0000121485	KERING	1'498	678	2'176	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	2'767	0	2'767	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	12'618	15'591	13'228	14'981 EUR	23.23	337'061.86	0.04	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2'817	11'122	11'028	2'911 EUR	156.98	442'594.62	0.06	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	0	23'535	8'526	15'009 EUR	27.43	398'746.76	0.05	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	0	7'130	0	7'130 EUR	71.76	495'554.65	0.06	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	28'594	26'958	32'277	23'275 EUR	23.05	519'500.54	0.07	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	17'236	5'448	6'843	15'841 EUR	60.43	927'160.21	0.12	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	11'738	5'674	17'412	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010208488	ENGIE	0	48'768	33'829	14'939 EUR	14.53	210'235.83	0.03	a)
FR0010242511	EDF	0	30'984	30'984	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010259150	IPSEN	481	0	481	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010307819	LEGRAND SA	9'112	9'086	10'150	8'048 EUR	87.30	680'490.10	0.09	a)
FR0013176526	VALEO	0	16'519	4'644	11'875 EUR	16.33	187'818.95	0.02	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	15'179	0	15'179	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>FR</b>							<b>7'155'056.93</b>	<b>0.91</b>	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	7'200	4'904	4'255	7'849 AUD	113.55	526'206.96	0.07	a)
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	0	25'509	25'509	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0001367019	BRITISH LAND CO PLC	39'461	55'155	94'616	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	23'387	26'120	23'387	26'120 GBP	758.00	221'067.10	0.03	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	187'636	46'748	69'785	164'599 GBP	644.90	1'185'226.35	0.15	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	17'772	32'483	50'255	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007908733	SSE PLC	5'679	49'008	54'687	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	30'567	57'013	87'580	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	1'715	2'544	2'030	2'229 GBP	11'102.00	276'307.72	0.04	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	291'397	166'603	215'308	242'692 GBP	158.94	430'695.56	0.06	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.
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	0	28'275	6'588	21'687	GBP	1'908.50	462'139.81	0.06 a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	0	474'014	62'852	411'162	GBP	154.45	709'059.39	0.09 a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	0	45'742	32'186	13'556	GBP	4'062.00	614'827.40	0.08 a)
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	17'821	29'488	17'821	29'488	GBP	1'619.50	533'221.93	0.07 a)
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	7'399	0	7'399	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	0	7'607	7'607	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00B2B0DG97	RELX PLC	32'719	47'437	56'840	23'316	GBP	2'775.00	722'434.98	0.09 a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	47'894	3'501	29'043	22'352	GBP	989.00	246'827.99	0.03 a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	0	4'763	0	4'763	GBP	2'000.00	106'363.42	0.01 a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	0	7'140	3'213	3'927	USD	62.48	224'454.38	0.03 a)
GB00BDRO5C01	NATIONAL GRID PLC	0	46'459	46'459	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	0	846'332	0	846'332	GBP	76.82	725'933.43	0.09 a)
GB00BJFFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	2'779	6'184	8'963	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	0	245'482	0	245'482	GBP	264.20	724'159.44	0.09 a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	141'681	90'210	231'891	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BM8Q5M07	JD SPORTS FASHION PLC	0	30'204	30'204	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BN7SWP63	GSK PLC	0	45'077	32'099	12'978	GBP	1'492.00	216'201.31	0.03 a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	58'166	18'758	22'738	54'186	GBP	2'606.00	1'576'678.82	0.20 a)
GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC	0	21'652	21'652	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE00DB6Q211	WILLIS TOWERS WATSON PLC	0	3'279	3'279	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	14'367	5'017	8'036	11'348	USD	64.75	672'179.49	0.09 a)
IE00BZ12WP82	LINDE PLC	0	1'292	1'292	0	USD	0.00	0.00	0.00
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	141'859	0	141'859	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00BJJN4441	CLARIVATE PLC	0	22'573	22'573	0	USD	0.00	0.00	0.00
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	6'406	5'962	6'837	5'531	GBP	13'475.07	832'178.53	0.11 a)
IE00059YS762	LINDE PLC	0	2'896	2'896	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	13'796	13'796	0	EUR	0.00	0.00	0.00
<b>GB</b>								<b>11'006'164.01</b>	<b>1.41</b>
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	0	427'556	427'556	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	479'000	186'000	567'000	98'000	HKD	8.18	93'635.64	0.01 a)
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	406'000	660'000	599'000	467'000	HKD	5.46	297'831.98	0.04 a)
HK0016000132	SUN HUNG KAI PROPERTIES	0	80'000	80'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	19'500	206'000	225'500	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	31'000	382'500	139'500	274'000	HKD	21.45	686'498.61	0.09 a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	53'500	0	53'500	0	HKD	0.00	0.00	0.00
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	115'000	115'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00
<b>HK</b>								<b>1'077'966.23</b>	<b>0.14</b>
AU000000JHX1	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	25'030	0	25'030	0	AUD	0.00	0.00	0.00
CRH ID	CRH PLC	9'264	3'004	2'268	10'000	EUR	52.36	507'141.17	0.06 a)
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	7'178	0	7'178	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE0002424939	DCC PLC	0	966	966	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	2'985	2'019	2'718	2'286	USD	307.11	642'238.51	0.08 a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0	2'240	470	1'770	USD	129.44	209'588.73	0.03 a)
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	0	65'766	0	65'766	EUR	4.26	271'350.50	0.03 a)
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	4'934	4'934	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE00BQPQZ61	HORIZON THERAPEUTICS PLC	0	4'045	4'045	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	4'590	4'590	0	USD	0.00	0.00	0.00
<b>IE</b>								<b>1'630'318.91</b>	<b>0.21</b>
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	1'684	0	0	1'684	USD	133.28	205'320.93	0.03 a)
<b>IL</b>								<b>205'320.93</b>	<b>0.03</b>
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	24'742	9'176	33'918	0	GBP	0.00	0.00	0.00
<b>IM</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	0	61'256	17'174	44'082	EUR	19.37	826'796.04	0.11 a)
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	0	25'238	25'238	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	240'194	156'364	155'564	240'994	EUR	2.44	569'528.75	0.07 a)
IT0003128367	ENEL SPA	60'563	25'912	86'475	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	61'171	30'790	63'505	28'456	EUR	9.97	274'727.09	0.04 a)
<b>IT</b>								<b>1'671'051.88</b>	<b>0.21</b>
JE00BYSS4X48	NOVOCURE LTD	0	7'557	7'557	0	USD	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.
<b>JE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
JP3143600009	ITOCHU CORP	28'600	24'200	52'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3160400002	EISAI CO LTD	0	4'300	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	0	43'100	43'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	16'575	0	16'575	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3180400008	OSAKA GAS CO LTD	23'600	0	23'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	27'400	0	27'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	39'400	0	39'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3218900003	CAPCOM CO LTD	3'400	0	3'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3256000005	KYOWA KIRIN CO LTD	0	7'600	7'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3258000003	KIRIN HOLDINGS CO LTD	44'700	0	44'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3294460005	INPEX CORP	63'000	0	63'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	0	182'700	182'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3409000001	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMEN	0	2'700	2'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	0	40'500	40'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY GROUP CORP	2'700	0	2'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	22'600	0	22'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	2'009	0	2'009	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3547670004	PERSOL HOLDINGS CO LTD	8'400	19'200	27'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3551520004	DENTSU GROUP INC	6'900	0	6'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	34'500	0	34'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3596200000	TOTO LTD	0	15'100	15'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3621000003	TORAY INDUSTRIES INC	63'600	62'400	126'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3626800001	LIXIL CORP	39'300	0	39'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	1'840	0	1'840	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	2'500	8'900	11'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3695200000	NGK INSULATORS LTD	45'900	0	45'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	3'300	2'800	6'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	25'100	0	25'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	0	12'300	12'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3802300008	FAST RETAILING CO LTD	0	400	400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	19'800	0	19'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3868400007	MAZDA MOTOR CORP	15'500	0	15'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3877600001	MARUBENI CORP	9'400	0	9'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	0	10'700	10'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3892100003	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	10'100	8'600	18'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893200000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	8'000	0	8'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893600001	MITSUI & CO LTD	3'100	0	3'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	39'900	0	39'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	48'791	18'600	67'391	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942600002	YAMAHA CORP	16'400	0	16'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942800008	YAMAHA MOTOR CO LTD	0	18'500	18'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3944130008	USS CO LTD	7'500	17'000	24'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	9'500	13'200	22'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
<b>JP</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
LU0156801721	TENARIS SA	0	20'388	20'388	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	106'996	152'527	53'443	206'080 EUR	3.12	622'545.10	0.08	a)
NL0000303709	AEGON NV	1'597	21'760	1'597	21'760 EUR	4.58	96'568.07	0.01	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	7'204	3'068	3'820	6'452 EUR	114.65	716'453.51	0.09	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	0	4'900	320	4'580 USD	199.92	837'621.62	0.11	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	1'677	1'462	2'478	661 EUR	559.10	357'940.26	0.05	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	5'842	5'667	175 EUR	30.44	5'159.44	0.00	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	0	14'741	5'536	9'205 EUR	28.52	254'268.71	0.03	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	7'415	6'919	9'979	4'355 EUR	68.48	288'849.43	0.04	a)
<b>NL</b>							<b>3'179'406.14</b>	<b>0.41</b>	
NO0010096985	EQUINOR ASA	13'445	17'617	16'274	14'788 NOK	351.15	446'428.56	0.06	a)
NO0010345853	AKER BP ASA	0	19'126	19'126	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
<b>NO</b>							<b>446'428.56</b>	<b>0.06</b>	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	0	3'508	0	3'508 NZD	34.20	65'944.40	0.01	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.
NZMELE000257	MERIDIAN ENERGY LTD	543	102'323	102'866	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	30'654	26'915	57'569	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
<b>NZ</b>							<b>65'944.40</b>	<b>0.01</b>	
PTEDPOAM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	0	25'085	25'085	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	9'238	14'899	13'529	10'608 EUR	14.04	144'251.46	0.02	a)
<b>PT</b>							<b>144'251.46</b>	<b>0.02</b>	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	0	56'970	10'946	46'024 SEK	155.46	602'464.44	0.08	a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	25'179	0	25'179	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	0	85'693	44'900	40'793 SEK	225.60	774'913.33	0.10	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	0	14'122	0	14'122 SEK	130.65	155'358.14	0.02	a)
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	10'975	0	10'975	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000667925	TELIA CO AB	181'895	369'797	551'692	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	3'233	0	3'233	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	5'692	57'089	62'781	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	34'244	34'244	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	25'906	0	25'906	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	0	11'968	11'968	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0012673267	EVOLUTION AB	0	1'692	1'692	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811955	INVESTOR AB-A SHS	0	21'534	21'534	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015812219	SWEDISH MATCH AB	33'365	8'747	42'112	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
<b>SE</b>							<b>1'532'735.91</b>	<b>0.20</b>	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	43'129	13'937	28'085	28'981 USD	3.54	93'851.84	0.01	a)
SG1B51001017	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	0	10'600	10'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1M31001969	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1'500	11'100	12'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1M77906915	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	0	190'200	190'200	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1S04926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	83'500	50'900	44'822	89'578 SGD	12.81	769'087.61	0.10	a)
<b>SG</b>							<b>862'939.45</b>	<b>0.11</b>	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	16'547	16'547	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	0	43'986	4'920	39'066 USD	14.52	518'909.62	0.07	a)
GB00BFBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	0	15'247	15'247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	0	3'559	0	3'559 USD	27.14	88'361.68	0.01	a)
IE00059YS762	LINDE PLC	0	2'216	1'132	1'084 USD	372.35	369'238.35	0.05	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	0	5'004	0	5'004 USD	213.28	976'323.15	0.12	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	15'025	3'953	4'236	14'742 USD	53.21	717'589.08	0.09	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	4'495	4'495	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00165C2035	AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	0	34'015	34'015	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	18'569	65'687	26'967	57'289 USD	15.02	787'167.82	0.10	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	1'919	7'415	4'376	4'958 USD	96.85	439'270.77	0.06	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	11'228	592	8'275	3'545 USD	149.06	483'396.51	0.06	a)
US00507V1098	ACTIVISION BLIZZARD INC	0	4'220	4'220	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00724F1012	ADOBE INC	4'047	707	1'447	3'307 USD	509.90	1'542'571.71	0.20	a)
US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	0	2'128	2'128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	14'770	1'925	12'564	4'131 USD	102.82	388'560.77	0.05	a)
US0090661010	AIRBNB INC-CLASS A	0	3'617	3'617	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1'841	3'335	5'176	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	5'744	0	5'744	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	18'588	15'349	6'419	27'518 USD	26.68	671'628.08	0.09	a)
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	19'682	8'474	17'189	10'967 USD	131.85	1'322'799.84	0.17	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	35'677	13'011	5'773	42'915 USD	130.86	5'137'385.89	0.66	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	0	22'939	18'417	4'522 USD	42.05	173'949.31	0.02	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	33'900	12'910	5'180	41'630 USD	127.12	4'841'126.72	0.62	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	0	13'735	7'200	6'535 USD	149.19	891'890.34	0.11	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	4'396	3'209	1'956	5'649 USD	164.45	849'829.12	0.11	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	0	2'904	0	2'904 USD	179.97	478'104.56	0.06	a)
US0311621009	AMGEN INC	5'039	5'463	7'154	3'348 USD	268.76	823'144.80	0.11	a)
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	0	5'397	5'397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	0	3'215	852	2'363 USD	297.55	643'205.62	0.08	a)
US0367521038	ANTHEM INC	2'408	564	1'399	1'573 USD	435.42	626'560.85	0.08	a)
US0378331005	APPLE INC	68'022	7'463	5'934	69'551 USD	171.21	10'893'279.87	1.39	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	10'182	1'488	11'670	0 USD	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.
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3'526	5'215	8'741	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0404131064	ARISTA NETWORKS INC	1'347	3'811	5'158	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	3'306	1'757	4'460	603 USD	206.91	114'136.60	0.01	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	2'798	1'931	3'614	1'115 USD	240.58	245'392.08	0.03	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	230	111	297	44 USD	2'539.99	102'237.65	0.01	a)
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	1'316	5'461	6'777	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	3'812	3'812	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	48'018	0	37'521	10'497 USD	27.38	262'920.71	0.03	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	0	19'963	0	19'963 USD	42.65	778'880.80	0.10	a)
US0708301041	BATH & BODY WORKS INC	2'703	0	2'703	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0844231029	WR BERKLEY CORP	2'484	0	2'484	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	9'221	2'168	11'389	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09062X1037	BIOGEN INC	3'792	1'335	1'944	3'183 USD	257.01	748'363.88	0.10	a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	0	532	138	394 USD	3'083.95	1'111'551.80	0.14	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	0	16'425	9'560	6'865 USD	40.37	253'527.72	0.03	a)
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	2'571	2'571	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	18'080	2'287	1'564	18'803 USD	58.04	998'345.13	0.13	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	0	3'714	0	3'714 USD	179.05	608'334.41	0.08	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	2'345	1'098	1'905	1'538 USD	830.58	1'168'594.83	0.15	a)
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	0	3'719	0	3'719 USD	124.49	423'532.56	0.05	a)
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	9'155	2'476	11'631	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US125231003	THE CIGNA GROUP	1'677	1'536	3'213	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1264081035	CSX CORP	29'993	29'551	59'544	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	0	5'792	5'792	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12685J1051	CABLE ONE INC	445	0	445	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	0	39'963	13'487	26'476 USD	27.05	655'157.62	0.08	a)
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	4'617	259	731	4'145 USD	234.30	888'429.52	0.11	a)
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	13'497	7'480	5'198	15'779 USD	41.08	592'974.57	0.08	a)
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6'256	3'690	7'318	2'628 USD	97.05	233'317.36	0.03	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	0	7'998	932	7'066 USD	86.82	561'202.47	0.07	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	7'291	12'700	19'991	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1491231015	CATERPILLAR INC	4'061	5'323	6'549	2'835 USD	273.00	708'014.03	0.09	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1'336	2'602	2'503	1'435 USD	439.82	577'368.43	0.07	a)
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	4'029	2'682	6'711	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	4'108	10'533	2'620	12'021 USD	168.62	1'854'282.24	0.24	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0	744	386	358 USD	1'831.83	599'921.39	0.08	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	8'053	11'157	11'201	8'009 USD	91.63	671'339.40	0.09	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	31'559	12'943	15'077	29'425 USD	53.76	1'447'111.14	0.18	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	2'367	2'367	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1729674242	CITIGROUP INC	3'567	0	3'567	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	2'136	2'136	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	27'160	8'184	7'153	28'191 USD	55.98	1'443'675.32	0.18	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7'028	0	7'028	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US19260Q1076	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	0	2'830	2'830	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	6'503	5'262	11'765	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	36'534	22'117	24'881	33'770 USD	44.34	1'369'786.57	0.18	a)
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	0	15'457	15'457	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	11'452	11'383	11'927	10'908 USD	119.80	1'195'440.88	0.15	a)
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	8'118	2'022	1'189	8'951 USD	85.53	700'351.70	0.09	a)
US21036P1084	CONSTELLATION BRANDS INC-A	1'346	0	1'346	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2172041061	COPART INC	0	7'104	7'104	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22052L1044	CORTEVA INC	14'087	3'491	17'578	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	743	241	349	635 USD	564.96	328'184.13	0.04	a)
US22788C1053	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	613	0	613	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	4'312	8'639	4'678	8'273 USD	92.03	696'495.96	0.09	a)
US2310211063	CUMMINS INC	3'415	860	4'275	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2358511028	DANAHER CORP	719	3'195	3'386	528 USD	248.10	119'835.87	0.02	a)
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	0	6'788	1'537	5'251 USD	143.22	687'973.71	0.09	a)
US23804L1035	DATADOG INC - CLASS A	0	2'729	2'729	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23918K1088	DAVITA INC	3'170	6'187	6'212	3'145 USD	94.53	271'967.16	0.03	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	0	1'207	0	1'207 USD	514.09	567'639.47	0.07	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.
US2441991054	DEERE & CO	1'233	1'508	2'741	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US24703L2025	DELL TECHNOLOGIES -C	0	3'176	3'176	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	0	2'719	0	2'719 USD	34.16	84'967.58	0.01	a)
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	8'997	8'997	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2521311074	DEXCOM INC	0	6'055	3'928	2'127 USD	93.30	181'541.24	0.02	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	1'737	6'361	8'098	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7'539	9'408	7'539	9'408 USD	86.63	745'575.76	0.10	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	2'703	2'703	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	856	856	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25809K1051	DOORDASH INC - A	3'163	1'326	4'489	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2600031080	DOVER CORP	5'627	0	5'627	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2605571031	DOW INC	0	36'779	20'579	16'200 USD	51.56	764'106.83	0.10	a)
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	25'116	9'730	25'116	9'730 USD	27.23	242'374.34	0.03	a)
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	1'877	6'467	8'344	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2681501092	DYNATRACE INC	0	6'903	6'903	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26875P1012	EOG RESOURCES INC	0	7'090	7'090	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26884L1098	EQT CORP	13'678	18'690	32'368	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	15'686	2'739	7'532	10'893 USD	44.09	439'353.16	0.06	a)
US2788651006	ECOLAB INC	4'953	0	0	4'953 USD	169.40	767'552.15	0.10	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8'921	13'698	12'092	10'527 USD	69.28	667'173.30	0.09	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	5'047	4'578	9'625	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	10'164	19'656	19'970	9'850 USD	96.57	870'171.02	0.11	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	174	174	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29444U7000	EQUINIX INC	1'364	1'206	1'351	1'219 USD	726.26	809'882.45	0.10	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	23'143	17'438	31'710	8'871 USD	28.39	230'390.27	0.03	a)
US29786A1060	ETSY INC	243	0	243	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	0	19'178	6'571	12'607 USD	58.15	670'637.18	0.09	a)
US30161N1019	EXELON CORP	0	3'987	3'987	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30212P3038	EXPEDIA GROUP INC	5'397	0	5'397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	5'669	0	5'669	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	23'984	117	11'565	12'536 USD	117.58	1'348'399.54	0.17	a)
US3024913036	FMC CORP	541	10'385	0	10'926 USD	66.97	669'372.17	0.09	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	5'653	3'376	1'909	7'120 USD	300.21	1'955'380.61	0.25	a)
US3032501047	FAIR ISAAC CORP	189	137	326	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US31428X1063	FEDEX CORP	0	4'292	1'991	2'301 USD	264.92	557'644.63	0.07	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10'190	24'311	19'495	15'006 USD	55.27	758'718.31	0.10	a)
US31620R3030	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	0	16'214	16'214	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	0	27'443	9'742	17'701 USD	25.33	410'165.52	0.05	a)
US3377381088	FISERV INC	0	5'226	0	5'226 USD	112.96	540'032.93	0.07	a)
US34959E1091	FORTINET INC	6'856	11'088	17'944	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	5'247	7'006	1'451	10'802 USD	74.16	732'824.62	0.09	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	8'144	0	8'144	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	20'147	20'147	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	5'001	13'885	12'628	6'258 USD	28.88	165'332.76	0.02	a)
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	0	4'155	4'155	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3666511072	GARTNER INC	0	1'385	1'385	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	8'052	10'840	18'892	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	11'684	5'144	3'685	13'143 USD	63.99	769'365.62	0.10	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	2'600	0	0	2'600 USD	144.38	343'404.94	0.04	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	14'984	3'535	4'235	14'284 USD	74.94	979'241.22	0.13	a)
US37940X1028	GLOBAL PAYMENTS INC	0	1'197	1'197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	1'659	4'176	5'835	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3841091040	GRACO INC	0	8'724	2'936	5'788 USD	72.88	385'889.57	0.05	a)
US3848021040	WW GRAINGER INC	0	1'226	283	943 USD	691.84	596'820.20	0.08	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	0	3'863	698	3'165 USD	245.98	712'196.23	0.09	a)
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	11'321	11'321	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4180561072	HASBRO INC	8'708	11'948	20'656	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4228061093	HEICO CORP	4'035	0	4'035	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4278661081	HERSHEY CO/THE	1'073	2'775	3'848	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42809H1077	HESS CORP	6'137	0	6'137	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	0	17'866	17'866	0 USD	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.
US4364401012	HOLOGIC INC	3'689	9'703	3'602	9'790 USD	69.40	621'538.90	0.08	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	5'269	0	3'329	1'940 USD	302.16	536'246.98	0.07	a)
US4435106079	HUBBELL INC	0	2'039	0	2'039 USD	313.41	584'596.53	0.07	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	1'049	448	1'181	316 USD	492.50	142'370.32	0.02	a)
US4448591028	HUMANA INC	1'322	358	1'680	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45167R1041	IDEX CORP	0	3'551	3'551	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45168D1046	IDEX LABORATORIES INC	0	702	702	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45337C1027	INCYTE CORP	0	12'080	0	12'080 USD	57.77	638'403.79	0.08	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	8'858	8'858	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	8'998	0	8'998	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	4'123	6'463	4'420	6'166 USD	140.30	791'384.15	0.10	a)
US4595061015	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6'560	9'433	15'993	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	0	21'003	5'144	15'859 USD	35.47	514'592.13	0.07	a)
US4606901001	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17'279	10'072	27'351	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4612021034	INTUIT INC	2'060	5'573	5'068	2'565 USD	510.94	1'198'901.29	0.15	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	4'554	2'593	5'579	1'568 USD	292.29	419'262.65	0.05	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	7'138	16'673	13'550	10'261 USD	59.45	558'043.05	0.07	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	12'264	5'826	5'735	12'355 USD	145.02	1'639'067.38	0.21	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	11'592	0	4'531	7'061 USD	155.75	1'006'051.99	0.13	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	0	6'690	0	6'690 USD	27.79	170'075.13	0.02	a)
US4824801009	KLA CORP	1'808	0	1'808	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4878361082	KELLANOVA	9'206	11'715	9'206	11'715 USD	59.51	637'761.65	0.08	a)
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	11'940	11'940	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	59'519	59'519	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4'573	5'632	4'573	5'632 USD	132.31	681'681.44	0.09	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	0	6'141	0	6'141 USD	120.85	678'909.53	0.09	a)
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3'573	0	3'573	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	11'076	11'076	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5010441013	KROGER CO	15'976	2'225	18'201	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	10'433	1'951	12'384	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1'428	0	1'428	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	0	1'523	0	1'523 USD	626.77	873'241.29	0.11	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	4'743	1'379	1'610	4'512 USD	537.13	2'217'045.76	0.28	a)
US5341871094	LINCOLN NATIONAL CORP	0	16'733	16'733	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5486611073	LOWE'S COS INC	5'851	3'233	5'851	3'233 USD	207.84	614'696.86	0.08	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	0	38'291	4'772	33'519 USD	5.59	171'407.18	0.02	a)
US5502411037	LUMEN TECHNOLOGIES INC	0	37'412	37'412	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US55354G1004	MSCI INC	715	1'602	2'317	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	0	32'983	12'748	20'235 USD	26.75	495'168.66	0.06	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	0	4'235	0	4'235 USD	151.34	586'318.10	0.07	a)
US5738741041	MARVELL TECHNOLOGY INC	0	6'245	6'245	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	3'988	3'422	2'006	5'404 USD	395.91	1'957'212.44	0.25	a)
US57638P1049	MASTERBRAND INC	0	3'067	3'067	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57667L1070	MATCH GROUP INC	4'968	4'557	9'525	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5801351017	MCDONALD'S CORP	547	1'173	860	860 USD	263.44	207'255.62	0.03	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	0	901	0	901 USD	434.85	358'418.50	0.05	a)
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	16'608	1'017	914	16'711 USD	102.95	1'573'819.59	0.20	a)
US59156R1086	METLIFE INC	12'996	0	12'996	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5926881054	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0	341	341	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5949181045	MICROSOFT CORP	32'265	4'748	4'420	32'593 USD	315.75	9'414'426.12	1.20	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	0	5'314	0	5'314 USD	78.05	379'420.34	0.05	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	0	4'808	0	4'808 USD	68.03	299'220.32	0.04	a)
US60770K1079	MODERNA INC	2'826	0	2'826	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE INC	0	566	566	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9'887	11'540	9'887	11'540 USD	63.59	671'306.40	0.09	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	12'875	1'982	9'148	5'709 USD	81.67	426'529.19	0.05	a)
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	5'694	2'818	8'512	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US62944T1051	NVR INC	0	67	67	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	0	3'390	2'128	1'262 USD	75.88	87'601.76	0.01	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	0	363	0	363 USD	377.60	125'390.54	0.02	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	0	14'531	0	14'531 USD	20.06	266'656.75	0.03	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.
US65339F1012	NEXTERA ENERGY INC	876	4'494	5'370	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6541061031	NIKE INC -CL B	0	2'313	2'313	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US65473P1057	NISOURCE INC	6'332	21'534	27'866	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELOCK INC	0	22'819	22'819	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6703461052	NUCOR CORP	0	5'695	0	5'695 USD	156.35	814'550.04	0.10	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	11'101	5'905	4'840	12'166 USD	434.99	4'841'202.41	0.62	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0	344	0	344 USD	908.86	286'010.24	0.04	a)
US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1'114	10'634	11'748	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	0	3'353	0	3'353 USD	74.48	228'454.32	0.03	a)
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	5'057	0	5'057	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68389X1054	ORACLE CORP	4'209	6'221	6'878	3'552 USD	105.92	344'173.23	0.04	a)
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	0	18'351	18'351	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	6'291	6'291	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	0	6'084	0	6'084 USD	136.41	759'209.39	0.10	a)
US69331C1080	P G & E CORP	0	22'147	22'147	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1'903	7'039	4'989	3'953 USD	122.77	443'961.41	0.06	a)
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	0	12'028	5'576	6'452 USD	129.80	766'117.19	0.10	a)
US69370C1009	PTC INC	0	1'781	1'781	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	4'553	2'423	2'130 USD	234.44	456'811.97	0.06	a)
US7043261079	PAYCHEX INC	342	0	342	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	0	21'760	16'849	4'911 USD	58.46	262'636.39	0.03	a)
US7134481081	PEPSICO INC	9'256	9'100	15'570	2'786 USD	169.44	431'840.34	0.06	a)
US7170811035	PFIZER INC	30'677	45'977	34'865	41'789 USD	33.17	1'268'041.91	0.16	a)
US71880K1016	PHINIA INC	0	3'272	3'272	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72352L1061	PINTEREST INC- CLASS A	0	9'966	9'966	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	0	694	0	694 USD	229.55	145'734.68	0.02	a)
US72919P2020	PLUG POWER INC	2'995	8'803	11'798	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	14'603	6'354	6'587	14'370 USD	145.86	1'917'428.30	0.25	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	7'866	11'174	10'817	8'223 USD	94.89	713'800.57	0.09	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	0	11'302	2'455	8'847 USD	74.05	599'304.10	0.08	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	5'804	8'605	5'948	8'461 USD	111.06	859'618.04	0.11	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	0	6'150	799	5'351 USD	121.86	596'516.25	0.08	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	0	1'425	0	1'425 USD	822.96	1'072'802.43	0.14	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	15'556	25'555	32'719	8'392 USD	17.20	132'044.43	0.02	a)
US7595091023	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	0	3'299	613	2'686 USD	262.23	644'339.18	0.08	a)
US76954A1034	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	5'585	7'720	13'305	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	616	8'885	3'862	5'639 USD	73.28	378'019.07	0.05	a)
US7739031091	ROCKWELL AUTOMATION INC	0	1'578	1'578	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7757111049	ROLLINS INC	0	5'692	5'692	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7782961038	ROSS STORES INC	0	2'985	2'985	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	629	0	629	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	0	4'069	3'569	500 USD	200.17	91'557.76	0.01	a)
US79466L3024	SALESFORCE INC	4'423	7'741	5'092	7'072 USD	202.78	1'311'878.23	0.17	a)
US8168511090	SEMPRA	4'855	0	4'855	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81762P1021	SERVICENOW INC	0	3'545	1'557	1'988 USD	558.96	1'016'537.18	0.13	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	0	8'807	2'826	5'981 USD	108.03	591'077.37	0.08	a)
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	0	80'008	80'008	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8318652091	SMITH (A.O.) CORP	6'232	0	6'232	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	0	1'678	0	1'678 USD	122.91	188'671.08	0.02	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	3'092	228	544	2'776 USD	255.06	647'720.99	0.08	a)
US83304A1060	SNAP INC - A	13'038	20'830	33'868	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8552441094	STARBUCKS CORP	0	6'402	6'402	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8574771031	STATE STREET CORP	0	11'604	0	11'604 USD	66.96	710'803.11	0.09	a)
US8581191009	STEEL DYNAMICS INC	0	2'730	2'730	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'625	0	456	2'169 USD	458.97	910'688.82	0.12	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	19'927	29'074	28'603	20'398 USD	30.57	570'438.96	0.07	a)
US8718291078	SYSCO CORP	0	12'138	0	12'138 USD	66.05	733'408.79	0.09	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	671	2'380	3'051	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US87918A1051	TELADOC HEALTH INC	5'435	4'975	10'410	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88160R1014	TESLA INC	12'330	3'139	4'556	10'913 USD	250.22	2'497'999.41	0.32	a)
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	0	7'342	7'342	0 USD	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.
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	439	351	319	471 USD	506.17	218'093.87	0.03	a)
US88579Y1010	3M CO	7'247	2'601	683	9'165 USD	93.62	784'923.37	0.10	a)
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	0	2'205	2'205	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89400J1079	TRANSUNION	0	4'268	0	4'268 USD	71.79	280'294.46	0.04	a)
US8962391004	TRIMBLE INC	7'266	4'048	11'314	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	0	19'279	0	19'279 USD	28.61	504'578.24	0.06	a)
US9026811052	UGI CORP	17'664	36'885	54'549	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	0	26'088	2'514	23'574 USD	45.99	991'797.12	0.13	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	638	867	1'505	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3'014	2'365	5'379	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113631090	UNITED RENTALS INC	2'391	643	1'177	1'857 USD	444.57	755'228.23	0.10	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	5'152	12	522	4'642 USD	504.19	2'141'043.64	0.27	a)
US9182041080	VF CORP	0	43'993	7'328	36'665 USD	17.67	592'671.98	0.08	a)
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	2'894	2'520	3'005	2'409 USD	221.89	488'990.80	0.06	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	2'172	8'136	7'674	2'634 USD	141.71	341'462.04	0.04	a)
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2'394	0	2'394	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92276F1003	VENTAS INC	2'890	0	2'890	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343E1029	VERISIGN INC	0	1'658	1'658	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	8'646	54'433	46'016	17'063 USD	32.41	505'895.22	0.06	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	0	3'528	0	3'528 USD	236.24	762'444.38	0.10	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3'209	1'811	1'949	3'071 USD	347.74	976'923.65	0.12	a)
US9256521090	VICI PROPERTIES INC	8'027	3'257	11'284	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	10'143	5'112	5'378	9'877 USD	230.01	2'078'250.66	0.27	a)
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	0	5'510	5'510	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	3'249	3'249	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9311421039	WALMART INC	1'603	7'222	5'133	3'692 USD	159.93	540'154.24	0.07	a)
US9344231041	WARNER BROS DISCOVERY INC	32'552	0	32'552	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9418481035	WATERS CORP	1'768	0	1'768	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	2'086	15'396	17'482	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US95040Q1040	WELLTOWER INC	1'028	2'208	3'236	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US96145D1054	WESTROCK CO	0	23'538	23'538	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	0	3'793	0	3'793 USD	214.85	745'494.35	0.10	a)
US98419M1009	XYLEM INC	0	9'053	1'694	7'359 USD	91.03	612'815.16	0.08	a)
US9884981013	YUM! BRANDS INC	6'690	2'379	9'069	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9892071054	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2'352	0	2'352	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	0	9'304	0	9'304 USD	46.16	392'881.57	0.05	a)
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	6'509	6'509	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98978V1035	ZOETIS INC	5'696	1'835	6'868	663 USD	173.98	105'521.03	0.01	a)
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	5'174	10'980	5'633	10'521 USD	16.40	157'843.62	0.02	a)
US98980G1022	ZSCALER INC	0	1'651	1'651	0 USD	0.00	0.00	0.00	

**US** **146'803'823.27** **18.77**

**Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte** **265'873'649.05** **33.99**

AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	1'000	0	500	500 AUD	100.11%	295'530.69	0.04	a)
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	820	0	0	820 AUD	97.70%	473'017.13	0.06	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	1'500	0	500	1'000 AUD	70.90%	418'578.43	0.05	a)
FR0014002829	1.7950 % BNP 1.795 09/03/27 ENTN	1'000	0	0	1'000 AUD	87.86%	518'724.10	0.07	a)

**AUD** **1'705'850.35** **0.22**

CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	1'000	0	0	1'000 CAD	86.32%	584'030.78	0.07	a)
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	1'000	0	0	1'000 CAD	91.14%	616'678.05	0.08	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	500	0	0	500 CAD	80.14%	271'117.76	0.03	a)
CA780086SY14	1.6700 % RY 1.67 01/28/33	1'000	0	0	1'000 CAD	82.88%	560'815.71	0.07	a)
CA89117FA338	1.8880 % TD 1.888 03/08/28	500	0	0	500 CAD	85.60%	289'596.45	0.04	a)

**CAD** **2'322'238.75** **0.30**

CH0109674488	3.1250 % AXPOS 3 1/8 02/26/25	2'000	0	0	2'000 CHF	100.80%	2'016'000.00	0.26	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	500	0	0	500 CHF	99.95%	499'750.00	0.06	a)
CH0240672227	1.6250 % SYN NVX 1 5/8 11/01/24	2'200	0	0	2'200 CHF	98.84%	2'174'480.00	0.28	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	95.50%	1'432'500.00	0.18	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.12	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.55%	1'991'000.00	0.25	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.80%	948'000.00	0.12	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.
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000 CHF	99.35%	993'500.00	0.13 a)	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	500	0	0	500 CHF	99.01%	495'050.00	0.06 a)	
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	500	0	0	500 CHF	99.63%	498'150.00	0.06 a)	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'445	0	0	1'445 CHF	95.05%	1'373'472.50	0.18 a)	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	500	0	0	500 CHF	95.30%	476'500.00	0.06 a)	
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	100	0	0	100 CHF	98.50%	98'500.00	0.01 a)	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.12 a)	
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.85%	928'500.00	0.12 a)	
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP	500	0	0	500 CHF	95.50%	477'500.00	0.06 a)	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	85.10%	1'702'000.00	0.22 a)	
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	500	0	0	500 CHF	95.60%	478'000.00	0.06 a)	
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.05%	980'500.00	0.13 a)	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'000	0	0	1'000 CHF	95.45%	954'500.00	0.12 a)	
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	1'500	0	0	1'500 CHF	95.25%	1'428'750.00	0.18 a)	
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	1'000	0	0	1'000 CHF	93.00%	930'000.00	0.12 a)	
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	1'500	0	0	1'500 CHF	97.75%	1'466'250.00	0.19 a)	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	97.70%	488'500.00	0.06 a)	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'000	0	0	1'000 CHF	99.17%	991'700.00	0.13 a)	
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	4'000	0	0	4'000 CHF	84.95%	3'398'000.00	0.43 a)	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.30%	1'926'000.00	0.25 a)	
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	2'000	0	0	2'000 CHF	87.35%	1'747'000.00	0.22 a)	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	0	0	2'000 CHF	90.65%	1'813'000.00	0.23 a)	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	1'000	0	0	1'000 CHF	93.95%	939'500.00	0.12 a)	
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'000	0	0	2'000 CHF	86.45%	1'729'000.00	0.22 a)	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	1'000	0	0	1'000 CHF	98.69%	986'900.00	0.13 a)	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	4'000	0	0	4'000 CHF	83.74%	3'349'600.00	0.43 a)	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.70%	977'000.00	0.12 a)	
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	1'000	0	0	1'000 CHF	89.00%	890'000.00	0.11 a)	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'000	0	0	1'000 CHF	79.55%	795'500.00	0.10 a)	
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.55%	915'500.00	0.12 a)	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.85%	1'797'000.00	0.23 a)	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	1'600	0	0	1'600 CHF	86.75%	1'388'000.00	0.18 a)	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.28%	982'800.00	0.13 a)	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.65%	1'933'000.00	0.25 a)	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.85%	1'857'000.00	0.24 a)	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.20%	962'000.00	0.12 a)	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.60%	916'000.00	0.12 a)	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'000	0	0	1'000 CHF	88.80%	888'000.00	0.11 a)	
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	93.15%	1'863'000.00	0.24 a)	
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	1'500	0	0	1'500 CHF	76.05%	1'140'750.00	0.15 a)	
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	630	0	0	630 CHF	93.40%	588'420.00	0.08 a)	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	86.25%	2'587'500.00	0.33 a)	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	85.00%	850'000.00	0.11 a)	
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'000	0	0	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.11 a)	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.30%	953'000.00	0.12 a)	
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'000	0	0	1'000 CHF	87.60%	876'000.00	0.11 a)	
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.70%	1'834'000.00	0.23 a)	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	2'000	0	0	2'000 CHF	87.50%	1'750'000.00	0.22 a)	
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.65%	926'500.00	0.12 a)	
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	1'200	0	0	1'200 CHF	86.00%	1'032'000.00	0.13 a)	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	1'700	0	0	1'700 CHF	87.45%	1'486'650.00	0.19 a)	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	900	0	0	900 CHF	79.40%	714'600.00	0.09 a)	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.60%	1'792'000.00	0.23 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.
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.10%	1'802'000.00	0.23	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	2'000	0	0	2'000 CHF	94.90%	1'898'000.00	0.24	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	84.00%	1'680'000.00	0.21	a)
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	900	0	0	900 CHF	91.70%	825'300.00	0.11	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	2'000	0	0	2'000 CHF	80.85%	1'617'000.00	0.21	a)
CH0539032943	1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.12	a)
CH0545766575	0.6250 % SWICC 2020-1 A	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	2'000	0	0	2'000 CHF	77.50%	1'550'000.00	0.20	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.12	a)
CH0550413360	0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.20%	1'824'000.00	0.23	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	600	0	0	600 CHF	97.00%	582'000.00	0.07	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.60%	976'000.00	0.12	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	88.45%	1'769'000.00	0.23	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.10%	1'802'000.00	0.23	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.50%	955'000.00	0.12	a)
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	1'250	0	0	1'250 CHF	90.25%	1'128'125.00	0.14	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'000	0	0	2'000 CHF	89.55%	1'791'000.00	0.23	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.65%	916'500.00	0.12	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	2'000	0	0	2'000 CHF	91.75%	1'835'000.00	0.23	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	70.75%	1'415'000.00	0.18	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	85.35%	853'500.00	0.11	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	85.70%	857'000.00	0.11	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'240	0	0	1'240 CHF	93.00%	1'153'200.00	0.15	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	86.45%	864'500.00	0.11	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.20%	892'000.00	0.11	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'500	0	0	1'500 CHF	94.70%	1'420'500.00	0.18	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	1'800	0	0	1'800 CHF	87.20%	1'569'600.00	0.20	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'000	0	0	2'000 CHF	86.10%	1'722'000.00	0.22	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.80%	1'856'000.00	0.24	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	1'450	0	0	1'450 CHF	89.35%	1'295'575.00	0.17	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'400	0	0	1'400 CHF	87.65%	1'227'100.00	0.16	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	89.95%	1'169'350.00	0.15	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.45%	1'809'000.00	0.23	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	2'000	0	1'000	1'000 CHF	87.30%	873'000.00	0.11	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	84.90%	2'292'300.00	0.29	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	1'500	0	0	1'500 CHF	74.74%	1'121'100.00	0.14	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500	0	0	1'500 CHF	87.75%	1'316'250.00	0.17	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	350	0	0	350 CHF	76.90%	269'150.00	0.03	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.40%	1'788'000.00	0.23	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	91.05%	1'456'800.00	0.19	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	89.00%	2'670'000.00	0.34	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	2'000	0	0	2'000 CHF	78.74%	1'574'800.00	0.20	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	4'000	0	0	4'000 CHF	82.60%	3'304'000.00	0.42	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	93.40%	4'670'000.00	0.60	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	0	650 CHF	97.36%	632'840.00	0.08	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	2'000	0	0	2'000 CHF	95.90%	1'918'000.00	0.25	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	2'000	0	0	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.23	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	2'000	0	0	2'000 CHF	94.06%	1'881'200.00	0.24	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	2'000	0	0	2'000 CHF	85.80%	1'716'000.00	0.22	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.95%	1'899'000.00	0.24	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.05%	980'500.00	0.13	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	2'000	0	0	2'000 CHF	97.80%	1'956'000.00	0.25	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	1'000	0	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.12	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	2'000	0	0	2'000 CHF	96.85%	1'937'000.00	0.25	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.25	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.20%	1'944'000.00	0.25	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.00%	1'920'000.00	0.25	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.
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.13	a)
CH1202242223	1.5203 % NWISE 1.5203 12/17/29	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.12	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	0	800	0	800 CHF	106.65%	853'200.00	0.11	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.70%	997'000.00	0.13	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	545	0	545 CHF	100.30%	546'635.00	0.07	a)
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	1'500	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.20	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.65%	1'006'500.00	0.13	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.30%	2'006'000.00	0.26	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	2'000	0	2'000 CHF	102.15%	2'043'000.00	0.26	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	0	2'000	0	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.26	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.60%	1'006'000.00	0.13	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.13	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	2'000	0	2'000 CHF	98.42%	1'968'400.00	0.25	a)
<b>CHF</b>							<b>177'967'997.50</b>	<b>22.75</b>	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	0	8'000	0	8'000 CNY	105.69%	1'061'639.36	0.14	a)
X51958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	9'500	0	0	9'500 CNY	99.70%	1'189'243.15	0.15	a)
X52322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	8'000	0	0	8'000 CNY	99.52%	999'659.85	0.13	a)
X52332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.52%	1'249'537.14	0.16	a)
X52388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	8'000	0	0	8'000 CNY	99.44%	998'856.26	0.13	a)
X52437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	8'000	0	0	8'000 CNY	97.92%	983'588.15	0.13	a)
X52472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	2'500	0	0	2'500 CNY	101.56%	318'797.27	0.04	a)
<b>CNY</b>							<b>6'801'321.18</b>	<b>0.87</b>	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.30%	94'238.42	0.01	a)
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	1'000	0	0	1'000 EUR	69.13%	669'564.53	0.09	a)
DE000A3E5MH6	0.6250 % ANNGR 0 5/8 12/14/29 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3H3J30	0.7500 % VANTOW 0 3/4 03/31/30 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	300	0	0	300 EUR	87.36%	253'847.78	0.03	a)
EU000A3K4DVO	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	2'000	0	2'000 EUR	92.96%	1'800'737.38	0.23	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	0	1'500	0	1'500 EUR	84.00%	1'220'424.23	0.16	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	85.26%	825'810.13	0.11	a)
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	500	0	0	500 EUR	82.25%	398'313.94	0.05	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	500	0	0	500 EUR	76.49%	370'410.17	0.05	a)
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	46.85%	453'792.17	0.06	a)
PTOTECOEO037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	100	0	0	100 EUR	48.17%	46'651.88	0.01	a)
X51767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	89.59%	1'735'379.99	0.22	a)
X51861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	89.90%	1'741'384.97	0.22	a)
X52049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	850	0	0	850 EUR	74.04%	609'510.89	0.08	a)
X52190201983	1.5000 % CROATI 1 1/2 06/17/31	550	0	0	550 EUR	83.83%	446'583.30	0.06	a)
X52194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	800	0	0	800 EUR	89.65%	694'640.14	0.09	a)
X52218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'000	0	0	1'000 EUR	89.73%	869'055.64	0.11	a)
X52227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	600	0	0	600 EUR	72.03%	418'597.20	0.05	a)
X52258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	250	0	0	250 EUR	58.92%	142'673.87	0.02	a)
X52261215011	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 04/23/31	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	700	0	0	700 EUR	77.35%	524'445.56	0.07	a)
X52293075680	1.5000 % ORSTED 1 1/2 02/18/3021	400	0	0	400 EUR	72.67%	281'528.78	0.04	a)
X52296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	900	0	0	900 EUR	90.74%	790'945.43	0.10	a)
X52314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	75.90%	882'196.86	0.11	a)
X52325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	650	0	0	650 EUR	73.39%	462'035.94	0.06	a)
X52337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	850	0	0	850 EUR	73.96%	608'909.91	0.08	a)
X52343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	1'050	0	0	1'050 EUR	87.99%	894'813.12	0.11	a)
X52343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	1'000	0	0	1'000 EUR	75.61%	732'306.84	0.09	a)
X52346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	1'150	0	0	1'150 EUR	81.57%	908'492.36	0.12	a)
X52350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.96%	246'859.73	0.03	a)
X52356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	650	0	0	650 EUR	79.65%	501'427.13	0.06	a)
X52357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	83.76%	892'367.54	0.11	a)
X52366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	1'100	0	0	1'100 EUR	75.80%	807'529.82	0.10	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.
X52388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'400	0	0	1'400 EUR	79.63%	1'079'766.38	0.14	a)
X52406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	350	0	0	350 EUR	90.53%	306'891.57	0.04	a)
X52408608219	1.9500 % PERU 1.95 11/17/36	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	0	1'650	0	1'650 EUR	95.88%	1'532'240.85	0.20	a)
<b>EUR</b>							<b>24'244'374.45</b>	<b>3.10</b>	
FR0000486763	5.5000 % CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN	321	0	0	321 GBP	100.07%	358'659.17	0.05	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	500	0	0	500 GBP	46.13%	257'534.37	0.03	a)
X51550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	99.14%	1'106'923.23	0.14	a)
X52170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	500	0	0	500 GBP	67.27%	375'554.67	0.05	a)
X52251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	500	0	0	500 GBP	90.76%	506'705.70	0.06	a)
X52322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	500	0	0	500 GBP	88.35%	493'223.25	0.06	a)
<b>GBP</b>							<b>3'098'600.39</b>	<b>0.40</b>	
FR0014003L79	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	97.41%	597'156.42	0.08	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	0	100'000	0	100'000 JPY	90.49%	554'740.60	0.07	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	200'000	0	0	200'000 JPY	82.27%	1'008'637.10	0.13	a)
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	0	200'000	0	200'000 JPY	99.04%	1'214'285.49	0.16	a)
X50307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	170'000	0	170'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52311539691	0.6800 % ISPIIM 0.68 03/11/24 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	99.92%	1'225'087.15	0.16	a)
X52330256236	0.6330 % AFL 0.633 04/15/31	200'000	0	0	200'000 JPY	93.65%	1'148'261.72	0.15	a)
X52352398171	0.3000 % DNBNO 0.3 06/11/27 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	98.72%	1'815'469.54	0.23	a)
X52387729408	0.4590 % HSBC 0.459 03/24/28 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	95.96%	1'176'510.33	0.15	a)
<b>JPY</b>							<b>8'740'148.35</b>	<b>1.12</b>	
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	76.82%	702'749.36	0.09	a)
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	1'500	0	0	1'500 USD	81.38%	1'116'641.47	0.14	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	2'000	0	0	2'000 USD	55.55%	1'016'287.91	0.13	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	1'500	0	0	1'500 USD	58.46%	802'243.01	0.10	a)
US038222AN54	1.7500 % AMAT 1 3/4 06/01/30	500	0	0	500 USD	80.00%	365'938.30	0.05	a)
US05890PAB22	2.8750 % BCICI 2 7/8 10/14/31 REGS	500	0	0	500 USD	79.98%	365'837.67	0.05	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	250	0	0	250 USD	78.18%	178'793.09	0.02	a)
US09659X2K76	3.0520 % BNP 3.052 01/13/31 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	82.58%	1'133'094.15	0.14	a)
US110122DQ80	1.4500 % BMY 1.45 11/13/30	1'000	0	0	1'000 USD	76.76%	702'209.63	0.09	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	400	0	0	400 USD	76.08%	278'395.60	0.04	a)
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	1'000	0	0	1'000 USD	81.07%	741'591.77	0.09	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	1'900	0	0	1'900 USD	77.63%	1'349'267.79	0.17	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	600	0	0	600 USD	94.51%	518'730.02	0.07	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	700	0	0	700 USD	83.21%	532'856.36	0.07	a)
US36830DAB73	2.9800 % PTTGC 2.98 03/18/31 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US370334CQ51	2.2500 % GIS 2 1/4 10/14/31	250	0	0	250 USD	77.79%	177'905.73	0.02	a)
US40434LAK17	4.0000 % HPQ 4 04/15/29	500	0	0	500 USD	91.30%	417'601.63	0.05	a)
US437076CJ91	1.8750 % HD 1 7/8 09/15/31	1'600	0	0	1'600 USD	77.48%	1'134'029.99	0.14	a)
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500	0	0	500 USD	84.49%	386'475.56	0.05	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	0	2'000	0	2'000 USD	87.82%	1'606'663.24	0.21	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	400	0	0	400 USD	94.98%	347'558.13	0.04	a)
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51	1'000	0	0	1'000 USD	65.34%	597'702.88	0.08	a)
US487836BX58	2.1000 % K 2.1 06/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	79.46%	726'936.67	0.09	a)
US532457BZ08	2.5000 % LLY 2 1/2 09/15/60	2'000	0	0	2'000 USD	54.36%	994'533.97	0.13	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	700	0	0	700 USD	78.33%	501'587.58	0.06	a)
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	600	0	0	600 USD	60.41%	331'567.43	0.04	a)
US594918CD48	2.6750 % MSFT 2.675 06/01/60	2'000	0	0	2'000 USD	58.77%	1'075'219.51	0.14	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	600	0	0	600 USD	76.32%	418'910.70	0.05	a)
US63859VBF76	1.0000 % NWDI 1 08/28/25 REGS	800	0	0	800 USD	91.00%	665'974.40	0.09	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	300	0	0	300 USD	88.26%	242'215.26	0.03	a)
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	200	0	0	200 USD	76.09%	139'212.43	0.02	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.
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	1'500	0	0	1'500 USD	82.00%	1'125'149.11	0.14	a)
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86964WAJ18	3.7500 % SUZANO 3 3/4 01/15/31	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	950	0	0	950 USD	80.41%	698'811.15	0.09	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	0	2'000	0	2'000 USD	74.03%	1'354'475.75	0.17	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	2'000	1'000	0	3'000 USD	55.77%	1'530'431.68	0.20	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	0	3'000	0	3'000 USD	61.41%	1'685'233.13	0.22	a)
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	0	9'400	0	9'400 USD	92.37%	7'942'926.07	1.02	a)
US91324PED06	2.3000 % UNH 2.3 05/15/31	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	220	0	0	220 USD	76.96%	154'886.62	0.02	a)
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	1'800	0	0	1'800 USD	89.98%	1'481'679.60	0.19	a)
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	800	0	0	800 USD	74.30%	543'735.16	0.07	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	2'000	0	1'000	1'000 USD	91.91%	840'765.24	0.11	a)
USP2000TAA36	3.2500 % BANBRA 3 1/4 09/30/26 REGS	400	0	0	400 USD	91.80%	335'925.54	0.04	a)
USU01386AF57	5.7500 % ALC5W 5 3/4 12/06/52 REGS	0	200	0	200 USD	95.68%	175'050.64	0.02	a)
USU4034GAA14	4.2500 % GGBRZ 4 1/4 01/21/30 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	600	0	0	600 USD	59.75%	327'966.78	0.04	a)
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	800	0	0	800 USD	89.36%	653'979.54	0.08	a)
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'400	0	0	1'400 USD	90.52%	1'159'346.17	0.15	a)
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	77.29%	1'414'024.66	0.18	a)
<b>USD</b>							<b>40'993'118.08</b>	<b>5.24</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1278642884	BONHOTE-IMMOBILIER SI-SCRIP	0	7'162	7'162	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1281523931	BALOISE SWISS PROPERTY FUND	0	3'002	3'002	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XR77	SHELL PLC-EEE AUG23	0	51'544	51'544	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	42'945	42'945	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	51'544	51'544	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BPVW887	SHELL PLC-EEE NOV2022	0	53'286	53'286	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	7'558	7'558	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	6'419	6'419	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LR8	NN GROUP NV	0	5'667	5'667	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>54'316'012.05</b>	<b>6.94</b>	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INTERSWISS	10'547	1'500	758	11'289 CHF	160.00	1'806'240.00	0.23	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	6'999	1'901	0	8'900 CHF	206.00	1'833'400.00	0.23	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	12'611	2'202	1'446	13'367 CHF	127.50	1'704'292.50	0.22	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	2'963	269	0	3'232 CHF	281.00	908'192.00	0.12	a)
CH0009778769	IMMOFONDS	3'862	600	0	4'462 CHF	514.00	2'293'468.00	0.29	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	19'284	3'500	2'000	20'784 CHF	201.00	4'177'584.00	0.53	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	38'638	5'500	3'500	40'638 CHF	77.60	3'153'508.80	0.40	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	16'566	3'000	2'000	17'566 CHF	120.00	2'107'920.00	0.27	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	73'907	14'000	8'000	79'907 CHF	127.00	10'148'189.00	1.30	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	37'623	4'000	3'000	38'623 CHF	59.80	2'309'655.40	0.30	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	6'708	1'364	700	7'372 CHF	203.00	1'496'516.00	0.19	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND	5'891	800	652	6'039 CHF	180.00	1'087'020.00	0.14	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	37'500	0	8'000	29'500 CHF	17.60	519'200.00	0.07	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	6'962	1'388	1'000	7'350 CHF	131.00	962'850.00	0.12	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	18'247	4'500	0	22'747 CHF	131.50	2'991'230.50	0.38	a)
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	7'083	1'000	1'000	7'083 CHF	142.00	1'005'786.00	0.13	a)
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	3'904	1'000	0	4'904 CHF	146.50	718'436.00	0.09	a)
CH0037430946	SWC (CH) REF RESPONSIBLE IFCA FA CHF	10'847	800	1'800	9'847 CHF	154.00	1'516'438.00	0.19	a)
CH0039415010	REALSTONE SWISS PROPERTY	13'207	3'347	2'000	14'554 CHF	121.50	1'768'311.00	0.23	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	17'606	3'500	1'500	19'606 CHF	114.00	2'235'084.00	0.29	a)
CH0111959190	SWC (CH) REF RESP SWISS COMMERCIAL FA CHF	7'034	0	1'500	5'534 CHF	96.40	533'477.60	0.07	a)
CH0120791253	SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND	1'100	4'455	0	5'555 CHF	114.50	636'047.50	0.08	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.
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	16'153	3'220	1'500	17'873	CHF	133.50	2'386'045.50	0.31 a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	27'515	0	0	27'515	CHF	13.25	364'573.75	0.05 a)
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A	4'314	2'992	0	7'306	CHF	91.00	664'846.00	0.08 a)
CH0285087455	SF RET PROP FD / UT CHF	4'120	1'300	0	5'420	CHF	104.00	563'680.00	0.07 a)
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	13'035	1'200	2'000	12'235	CHF	117.50	1'437'612.50	0.18 a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	15'628	3'500	1'000	18'128	CHF	142.00	2'574'176.00	0.33 a)
CH0414551033	BALOISE SWISS PROPERTY FD	0	3'632	0	3'632	CHF	113.50	412'232.00	0.05 a)
<b>CH</b>								<b>54'316'012.05</b>	<b>6.94</b>
IE00BM67HK77	X MSCI WORLD HEALTH CARE	0	81'623	81'623	0	EUR	0.00	0.00	0.00
<b>DE</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

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

								<b>133'597'238.70</b>	<b>17.08</b>
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>								<b>133'597'238.70</b>	<b>17.08</b>
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	375'367	0	62'367	313'000	CHF	49.40	15'461'151.14	1.98 a)
CH0388442359	SWC (CH) EF RESPONSIBLE SMC CH (II) NT CHF	247'758	10'843	12'716	245'884	CHF	117.02	28'773'987.17	3.68 a)
CH0394628066	SWC (CH) MMF RESPONSIBLE OPPS CHF NT CHF	0	104'503	0	104'503	CHF	95.86	10'018'106.94	1.28 a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	128'568	32'979	41'561	119'986	CHF	127.43	15'289'956.63	1.95 a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	125'247	0	0	125'247	CHF	87.87	11'005'147.11	1.41 a)
<b>CH</b>								<b>80'548'348.99</b>	<b>10.30</b>
0U0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	159'394	0	159'394	0	USD	0.00	0.00	0.00
0U1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	0	120'818	120'818	0	CHF	0.00	0.00	0.00
1U2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPS NT	143'032	143'032	286'064	0	USD	0.00	0.00	0.00
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	6'830	18'966	0	25'796	USD	266.16	6'280'863.48	0.80 a)
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	0	159'394	0	159'394	USD	119.65	17'446'600.97	2.23 a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	0	126'037	2'776	123'261	CHF	109.85	13'540'265.35	1.73 a)
LU2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPS NT	0	320'657	143'032	177'625	USD	97.12	15'781'159.91	2.02 a)
<b>LU</b>								<b>53'048'889.71</b>	<b>6.78</b>

### Nicht kotierte Wertpapiere

								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	900	0	0	900	USD	0.00%	0.00	0.00 c)
<b>USD</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

### Derivative Finanzinstrumente

								<b>-282'248.62</b>	<b>-0.04</b>
--	--	--	--	--	--	--	--	--------------------	--------------

### Optionen und Optionsscheine

								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
DE000C1YDJ07	SX5E 06/16/23 P4175	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00	0.00	0.00
SPX 07/23 P4050	SPX 07/21/23 P4050	0	60	60	0	USD	0.00	0.00	0.00

### Futures

								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
10/22	HANG SENG IDX FUT OCT22	97	0	97	0	HKD	0.00	0.00	0.00
11/22	HANG SENG IDX FUT NOV22	0	97	97	0	HKD	0.00	0.00	0.00
12/22	TOPIX INDX FUTR DEC22	-60	60	0	0	JPY	0.00	0.00	0.00
12/22	EURO-BUND FUTURE DEC22	-60	60	0	0	EUR	0.00	0.00	0.00
12/22	EURO-BOBL FUTURE DEC22	-50	50	0	0	EUR	0.00	0.00	0.00
12/22	EURO-SCHATZ FUT DEC22	40	0	40	0	EUR	0.00	0.00	0.00
12/22	SPI 200 FUTURES DEC22	-33	170	137	0	AUD	0.00	0.00	0.00
12/22	EURO STOXX 50 DEC22	-178	420	242	0	EUR	0.00	0.00	0.00
12/22	SWISS MKT IX FUTR DEC22	108	56	164	0	CHF	0.00	0.00	0.00
12/22	S&P500 EMINI FUT DEC22	-61	183	122	0	USD	0.00	0.00	0.00
12/22	FTSE 100 IDX FUT DEC22	49	91	140	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.
12/22	MSCI EMGMKT DEC22	-239	282	43	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	NASDAQ 100 E-MINI DEC22	33	0	33	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	S&P/TSX 60 IX FUT DEC22	-14	39	25	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/22	E-MINI RUSS 2000 DEC22	133	0	133	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 10YR ULTRA FUT DEC22	-80	80	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 2YR NOTE (CBT) DEC22	70	0	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	50	50	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-SCHATZ FUT MAR23	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	TOPIX INDX FUTR MAR23	0	25	25	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/23	BCOM COMDTY IND MAR23	0	1'054	1'054	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	AUST 10Y BOND FUT MAR23	0	83	83	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	SPI 200 FUTURES MAR23	0	67	67	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	0	488	488	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MKT IX FUTR MAR23	0	181	181	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	0	115	115	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	0	177	177	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/23	MSCI EMGMKT MAR23	0	43	43	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	NASDAQ 100 E-MINI MAR23	0	67	67	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P/TSX 60 IX FUT MAR23	0	39	39	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR ULTRA FUT MAR23	0	80	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 2YR NOTE (CBT) MAR23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	TOPIX INDX FUTR JUN23	0	56	56	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	50	50	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-SCHATZ FUT JUN23	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	AUST 10Y BOND FUT JUN23	0	83	83	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	289	289	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MKT IX FUTR JUN23	0	229	229	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P500 EMINI FUT JUN23	0	114	114	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	179	179	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	MSCI EMGMKT JUN23	0	371	371	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	NASDAQ 100 E-MINI JUN23	0	82	82	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P/TSX 60 IX FUT JUN23	0	39	39	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
06/23	E-MINI RUSS 2000 JUN23	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	BCOM COMDTY IND JUN23	0	1'054	1'054	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR ULTRA FUT JUN23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 2YR NOTE (CBT) JUN23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	50	50	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-SCHATZ FUT SEP23	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	360	360	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MKT IX FUTR SEP23	0	77	77	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P500 EMINI FUT SEP23	0	122	122	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	37	37	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	MSCI EMGMKT SEP23	0	371	371	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	NASDAQ 100 E-MINI SEP23	0	29	29	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P/TSX 60 IX FUT SEP23	0	39	39	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	E-MINI RUSS 2000 SEP23	0	196	196	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	AUST 10Y BOND FUT SEP23	0	113	113	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
09/23	BCOM COMDTY IND SEP23	0	536	536	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 10YR ULTRA FUT SEP23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SPI 200 FUTURES SEP23	0	39	39	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 2YR NOTE (CBT) SEP23	0	70	70	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-SCHATZ FUT DEC23	0	40	0	40 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	0	50	-50 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	0	30	-30 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	0	360	-360 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	0	0	110	-110 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	37	0	37 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	MSCI EMGMKT DEC23	0	80	0	80 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	0	43	0	43 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	0	0	24	-24 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	E-MINI RUSS 2000 DEC23	0	46	46	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	AUST 10Y BOND FUT DEC23	0	113	0	113 AUD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	0	0	50	-50 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	BCOM COMDTY IND DEC23	0	802	0	802 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	0	0	39	-39 AUD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	CAN 10YR BOND FUT DEC23	0	0	101	-101 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	0	50	0	50 USD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

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.
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		10'175'000	6'459'171		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		40'838'828	41'936'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		16'806'590	2'483'423'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		15'223'478	13'960'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		33'537'359	34'896'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		10'049'141	14'100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		7'254'075	52'793'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.11.2022		11'923'000	11'764'818		EUR/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		9'437'368	69'159'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		8'074'231	12'672'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		31'039'096	31'108'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		12'295'633	1'824'906'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		30'564'270	30'873'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		16'726'067	14'565'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		10'699'253	14'647'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.12.2022		11'923'000	11'824'158		EUR/USD	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.12.2022		11'675'431	11'923'000		USD/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		7'000'000	6'908'041		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		37'123'926	39'220'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		10'239'000	14'628'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		9'148'229	14'353'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		7'913'713	59'118'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		17'670'368	15'551'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2023		3'558'588	519'668'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.01.2023		5'000'000	5'191'510		EUR/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		13'160'792	13'388'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.01.2023		5'323'560	5'000'000		USD/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		39'109'548	42'471'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		21'857'962	22'252'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		17'483'825	15'757'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'182'373	599'308'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.02.2023		5'000'000	5'334'640		EUR/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		9'425'776	15'081'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		4'259'414	6'258'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		7'468'388	56'304'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		43'128'111	43'092'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		32'257'820	35'036'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		11'962'567	1'682'745'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		18'688'795	16'481'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		7'778'038	57'048'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		5'638'157	8'707'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/NOK Verfall 02.03.2023		174'161'000	17'196'042		NOK/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		44'149'825	44'444'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		26'046'412	27'872'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		11'196'746	9'902'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		9'253'086	14'722'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		3'941'916	573'544'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		4'244'150	6'174'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/NOK Verfall 04.04.2023		80'173'000	7'753'285		NOK/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		7'401'059	54'957'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/USD Verfall 04.04.2023		7'496'896	80'173'000		USD/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		10'529'344	9'330'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		15'672'305	23'299'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		3'703'000	2'259'015		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		23'530'914	25'797'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		24'151'634	24'275'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		8'721'016	65'612'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		4'215'514	612'574'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		21'004'652	23'522'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		25'179'528	25'643'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		4'447'000	2'616'793		AUD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		10'664'730	9'572'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		4'325'400	657'053'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		9'727'716	14'843'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		8'472'909	65'625'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		19'303'950	21'267'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		16'303'690	2'500'401'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		2'976'255	2'650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		5'245'032	8'910'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		24'837'716	25'597'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		16'018'202	24'064'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		8'270'298	64'764'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		1'479'000	1'676'877		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		28'816'012	32'158'000		CHF/USD	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.
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		15'921'282	2'560'519'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		24'473'576	25'094'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		7'955'472	64'348'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		16'113'715	23'821'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		10'570'052	17'795'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		12'184'950	1'985'095'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		23'675'228	24'687'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		11'376'132	13'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		6'309'705	5'650'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		8'197'062	12'468'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		10'566'121	18'116'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2023		16'497'074	135'543'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		31'827'511	36'234'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		32'098'042	33'563'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		5'792'000	3'761'250		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'473'178	4'343'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		11'768'848	1'944'663'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		6'553'562	5'879'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 09.10.2023		7'013'806	58'174'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		35'583'710	39'192'000		CHF/USD	-145'296.59	-0.02	b)
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		85'372'000	7'324'320		NOK/CHF	-3'459.04	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		8'828'000	5'212'254		AUD/CHF	-12'119.72	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		14'006'425	12'585'000		CHF/GBP	904.50	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		4'598'905	6'799'000		CHF/CAD	12'290.85	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		29'903'566	30'986'000		CHF/EUR	-44'642.92	-0.01	b)
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		11'946'000	1'951'014'000		CHF/JPY	-36'437.07	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		7'313'575	58'679'000		CHF/CNY	-37'608.58	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-266'368.57</b>	<b>-0.03</b>	

#### Kreditderivate

12/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.39 12/27	0	0	4'000	-4'000	USD	1.41	-51'533.05	-0.01	a)
-------	------------------------------------	---	---	-------	--------	-----	------	------------	-------	----

#### Swaps

04/33	IRS FIX LEG 1.8125% P.A. CHF	0	10'000	0	10'000	CHF	100.36%	10'035'653.00	1.28	b)
04/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	0	10'000	-10'000	CHF	100.00	-10'000'000.00	-1.28	b)

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'206'323.64	0.67
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	320'286'153.37	40.94
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	265'873'649.05	33.99
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	187'913'250.75	24.02
Andere Anlagen - Metallkonten	1'711.13	0.00
Derivative Finanzinstrumente	-282'248.62	-0.04
Sonstige Vermögenswerte	3'287'977.48	0.42
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>782'286'816.80</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-856'159.24	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>781'430'657.56</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	774'021'520.12	98.94
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-230'715.57	-0.03
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>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>	<b>75'116'132.83</b>	<b>9.60</b>
CH0010645932 GIVAUDAN-REG	1'013 CHF	2'994.00
		3'032'922.00
		0.39

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 30.09.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.	
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18'084	CHF	420.10	7'597'088.40	0.97
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2'863	CHF	571.60	1'636'490.80	0.21
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	1'637	CHF	459.00	751'383.00	0.10
CH0126881561	SWISS RE AG	11'874	CHF	94.32	1'119'955.68	0.14
CH0432492467	ALCON INC	86'038	CHF	70.94	6'103'535.72	0.78
FR0000120628	AXA SA	34'044	EUR	28.18	929'182.81	0.12
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2'911	EUR	156.98	442'594.62	0.06
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	15'009	EUR	27.43	398'746.76	0.05
FR0000131104	BNP PARIBAS	15'841	EUR	60.43	927'160.21	0.12
FR0010307819	LEGRAND SA	7'585	EUR	87.30	641'341.62	0.08
US00206R1023	AT&T INC	57'289	USD	15.02	787'167.82	0.10
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	1'704	USD	96.85	150'971.64	0.02
US00287Y1091	ABBVIE INC	3'545	USD	149.06	483'396.51	0.06
US00724F1012	ADOBE INC	779	USD	509.90	363'369.63	0.05
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	10'967	USD	131.85	1'322'799.84	0.17
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	42'915	USD	130.86	5'137'385.89	0.66
US0231351067	AMAZON.COM INC	39'845	USD	127.12	4'633'550.19	0.59
US0378331005	APPLE INC	69'222	USD	171.21	10'841'750.94	1.39
US0533321024	AUTOZONE INC	44	USD	2'539.99	102'237.65	0.01
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	394	USD	3'083.95	1'111'551.80	0.14
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	4'145	USD	234.30	888'429.52	0.11
US1491231015	CATERPILLAR INC	1'804	USD	273.00	450'531.68	0.06
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1'435	USD	439.82	577'368.43	0.07
US1667641005	CHEVRON CORP	12'021	USD	168.62	1'854'282.24	0.24
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	635	USD	564.96	328'184.13	0.04
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	9'850	USD	96.57	870'171.02	0.11
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	12'536	USD	117.58	1'348'399.54	0.17
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	7'120	USD	300.21	1'955'380.61	0.25
US4364401012	HOLOGIC INC	7'476	USD	69.40	474'629.71	0.06
US4370761029	HOME DEPOT INC	1'940	USD	302.16	536'246.98	0.07
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	6'166	USD	140.30	791'384.15	0.10
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	1'568	USD	292.29	419'262.65	0.05
US5324571083	ELI LILLY & CO	4'512	USD	537.13	2'217'045.76	0.28
US5494981039	LUCID GROUP INC	33'519	USD	5.59	171'407.18	0.02
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	4'736	USD	395.91	1'715'277.22	0.22
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	3	USD	1'267.88	3'479.57	0.00
US6174464486	MORGAN STANLEY	5'709	USD	81.67	426'529.19	0.05
US64110L1061	NETFLIX INC	322	USD	377.60	111'227.97	0.01
US7170811035	PFIZER INC	23'534	USD	33.17	714'113.72	0.09
US7475251036	QUALCOMM INC	8'461	USD	111.06	859'618.04	0.11
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	1'425	USD	822.96	1'072'802.43	0.14
US79466L3024	SALESFORCE INC	4'947	USD	202.78	917'684.05	0.12
US81762P1021	SERVICENOW INC	1'988	USD	558.96	1'016'537.18	0.13
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'169	USD	458.97	910'688.82	0.12
US88160R1014	TESLA INC	10'913	USD	250.22	2'497'999.41	0.32
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3'071	USD	347.74	976'923.65	0.12
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	9'295	USD	230.01	1'955'790.21	0.25
US9311421039	WALMART INC	3'692	USD	159.93	540'154.24	0.07
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>					<b>55'660'670.07</b>	<b>7.12</b>
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	1'000	CHF	92.85%	928'500.00	0.12
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'000	CHF	85.10%	1'702'000.00	0.22
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	1'000	CHF	98.05%	980'500.00	0.13
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	700	CHF	90.65%	634'550.00	0.08
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	1'000	CHF	93.95%	939'500.00	0.12
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	1'500	CHF	86.45%	1'296'750.00	0.17
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	2'000	CHF	96.65%	1'933'000.00	0.25
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'000	CHF	88.80%	888'000.00	0.11
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	100	CHF	93.40%	93'400.00	0.01
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'000	CHF	85.00%	850'000.00	0.11
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'000	CHF	87.60%	876'000.00	0.11

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 30.09.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'000 CHF	91.70%	1'834'000.00	0.23	
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	2'000 CHF	87.50%	1'750'000.00	0.22	
CH0506668869	3.0000 % UBS 3 PERP	1'200 CHF	86.00%	1'032'000.00	0.13	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	700 CHF	87.45%	612'150.00	0.08	
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	1'000 CHF	90.10%	901'000.00	0.12	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'000 CHF	84.00%	1'680'000.00	0.21	
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	500 CHF	80.85%	404'250.00	0.05	
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	600 CHF	97.00%	582'000.00	0.07	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	500 CHF	88.45%	442'250.00	0.06	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'500 CHF	91.75%	1'376'250.00	0.18	
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'000 CHF	70.75%	707'500.00	0.09	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	600 CHF	85.70%	514'200.00	0.07	
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'240 CHF	93.00%	1'153'200.00	0.15	
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'000 CHF	86.10%	1'722'000.00	0.22	
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	1'000 CHF	87.65%	876'500.00	0.11	
CH1118461008	0.1175 % ASBANK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'300 CHF	89.95%	1'169'350.00	0.15	
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	500 CHF	74.74%	373'700.00	0.05	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500 CHF	87.75%	1'316'250.00	0.17	
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'000 CHF	82.60%	1'652'000.00	0.21	
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650 CHF	97.36%	632'840.00	0.08	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	1'600 CHF	94.06%	1'504'960.00	0.19	
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	2'000 CHF	97.80%	1'956'000.00	0.25	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	1'100 CHF	97.55%	1'073'050.00	0.14	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.12	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	500 CHF	106.65%	533'250.00	0.07	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	500 CHF	99.70%	498'500.00	0.06	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	545 CHF	100.30%	546'635.00	0.07	
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	1'000 CHF	100.60%	1'006'000.00	0.13	
FR00140060B0	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000 EUR	46.85%	453'792.17	0.06	
US40434LAK17	4.0000 % HPQ 4 04/15/29	500 USD	91.30%	417'601.63	0.05	
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	100 USD	94.98%	86'889.53	0.01	
US594918CD48	2.6750 % MSFT 2.675 06/01/60	1'000 USD	58.77%	537'609.76	0.07	
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	2'000 USD	74.03%	1'354'475.75	0.17	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'000 USD	55.77%	1'530'431.68	0.20	
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'000 USD	61.41%	1'685'233.13	0.22	
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	9'400 USD	83.77%	7'942'926.07	1.02	
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	1'200 USD	89.98%	987'786.40	0.13	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	500 USD	59.75%	273'305.65	0.03	
XS2190201983	1.5000 % CROATI 1 1/2 06/17/31	550 EUR	83.83%	446'583.30	0.06	

#### Andere Wertpapiere

				<b>2'389'824.90</b>	<b>0.31</b>
CH0002785456	SOLVALOR 61	3'232 CHF	281.00	908'192.00	0.12
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	28'554 CHF	17.60	502'550.40	0.06
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A	170 CHF	91.00	15'470.00	0.00
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	7'235 CHF	117.50	850'112.50	0.11
CH0414551033	BALOISE SWISS PROPERTY FD	1'000 CHF	113.50	113'500.00	0.01

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

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

Zürcher Kantonalbank



## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59041192
CAD	1 = CHF	0.67662722
CNY	1 = CHF	0.12556017
CZK	100 = CHF	3.97670000
DKK	100 = CHF	12.98841400
EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
HKD	100 = CHF	11.68051000
HUF	100 = CHF	0.24941600
JPY	100 = CHF	0.61303400
NOK	100 = CHF	8.59705800
NZD	1 = CHF	0.54965758
SEK	100 = CHF	8.42031600
SGD	1 = CHF	0.67023225
USD	1 = CHF	0.91480000
ZAR	1 = CHF	0.04855781

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	16'868'444.05	11.333
Bond	CHF	131'239'422.79	88.171
Equity	CHF	739'042.76	0.497
Total	CHF	148'846'909.60	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	236'615'970.57	30.280
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	110'641'308.04	14.159
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

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

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

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

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	75'116'132.83
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	55'660'670.07
Andere Wertpapiere	CHF	2'389'824.90

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	Max	Eff	Max	Eff	Max
AA CHF	1.350	2.000	1.100		0.250		4.000	
CT CHF	0.730	1.300	0.480		0.250		4.000	

Periode: 06.03.2023 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %		PAF p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max
NT CHF	-	-	-		-		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

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

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

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	7.25000	2.53750	4.71250

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

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

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	1.142	0.399	0.743
NT CHF	Nein	CHF	1.413	0.494	0.919

## 13 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 23) Anpassung von 2 auf 4 Nachkommastellen per 16.12.2021.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen 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 der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens 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.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).  
Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen.

Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des jeweiligen Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des jeweiligen Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem

Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der 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) Portfolio Fund I**

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Relax

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Select

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Balance

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Ambition

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Focus

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Die Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen wird im Besonderen Teil des Fondsvertrages geregelt und soll in § 29 lit. a des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In der angepassten Bestimmung in § 29 lit. a des Fondsvertrages ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -rechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen und Notes, Bail-in Bonds sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören.

\*\*\*

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

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

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

Zürich, 14. April 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich