

# BLKB NEXT GENERATION FUND BALANCED

Jahresbericht per 30.09.2023

Teilvermögen des BLKB Next Generation Strategy  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
A	31859921	CHF
B	31859924	CHF
la	31859925	CHF
lt	31859926	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 26.01.2024

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

BLKB Next Generation Strategy,

mit den Teilvermögen

- ▶ BLKB Next Generation Fund Yield
- ▶ BLKB Next Generation Fund Balanced
- ▶ BLKB Next Generation Fund Growth
- ▶ BLKB Next Generation Fund Equity

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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	15
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
7	Pauschale Verwaltungskommission	17
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (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 Basellandschaftliche Kantonalbank, Rheinstrasse 7, 4410 Liestal  
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**

Basellandschaftliche Kantonalbank, Rheinstrasse 7, 4410 Liestal

### 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		429'652'693.13	389'575'797.86	421'546'778.25	332'522'294.44
<b>Klasse A</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		208'562'308.94	194'176'030.56	219'800'093.60	184'595'651.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'893'708.600	1'841'526.814	1'806'994.310	1'655'373.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.13	105.44	121.64	111.51
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		110.35	105.67	121.70	111.60
Ausschüttung je Anteil		0.20	0.15	0.15	0.15
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.32 %	1.35 %	1.36 %	1.32 %
<b>Klasse B</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		214'743'163.70	189'663'407.17	194'968'022.36	142'041'588.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'934'746.494	1'786'489.601	1'593'278.082	1'267'311.807
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.99	106.17	122.37	112.08
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.21	106.40	122.43	112.17
Thesaurierung je Anteil		0.18	0.13	0.13	0.13
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.32 %	1.35 %	1.36 %	1.32 %
<b>Klasse Ia</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'571'347.11	1'185'781.88	1'484'830.47	1'055'282.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'112.852	11'135.000	12'105.000	9'395.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.34	106.49	122.66	112.32
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.56	106.73	122.72	112.41
Ausschüttung je Anteil		0.70	0.65	0.65	0.65
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.77 %	0.80 %	0.81 %	0.77 %
<b>Klasse It</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'775'873.38	4'550'578.25	5'293'831.82	4'829'771.84
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		43'330.000	43'330.000	43'910.000	43'910.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.22	105.02	120.56	109.99
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		110.44	105.25	120.62	110.08
Thesaurierung je Anteil		0.68	0.64	0.63	0.63
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.77 %	0.80 %	0.81 %	0.77 %

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 A	4.57 %	-13.00 %	7.83 %	2.72 %
Klasse B	4.56 %	-13.00 %	7.82 %	2.73 %
Klasse Ia	5.17 %	-12.71 %	8.42 %	3.29 %
Klasse It	5.17 %	-12.71 %	8.42 %	3.29 %

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	3'060'362.33	54'883'476.45
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	142'900'730.64	129'243'802.19
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	157'004'664.05	131'885'452.80
Strukturierte Produkte	3'059'679.48	3'236'066.73
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	122'959'627.25	69'943'622.94
Derivative Finanzinstrumente	-119'341.87	-92'460.17
Sonstige Vermögenswerte	1'182'911.25	855'243.35
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>430'048'633.13</b>	<b>389'955'204.29</b>
Andere Verbindlichkeiten	-395'940.00	-379'406.43
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>429'652'693.13</b>	<b>389'575'797.86</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'841'526.814	1'806'994.310
Ausgegebene Anteile		135'031.108	149'521.326
Zurückgenommene Anteile		-82'849.322	-114'988.822
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'893'708.600</b>	<b>1'841'526.814</b>
Klasse B	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'786'489.601	1'593'278.082
Ausgegebene Anteile		279'695.040	310'202.348
Zurückgenommene Anteile		-131'438.147	-116'990.829
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'934'746.494</b>	<b>1'786'489.601</b>
Klasse Ia	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'135.000	12'105.000
Ausgegebene Anteile		4'027.852	1'000.000
Zurückgenommene Anteile		-1'050.000	-1'970.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'112.852</b>	<b>11'135.000</b>
Klasse It	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		43'330.000	43'910.000
Ausgegebene Anteile		-	9'330.000
Zurückgenommene Anteile		-	-9'910.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>43'330.000</b>	<b>43'330.000</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.10.2022 30.09.2023</b>	<b>01.10.2021 30.09.2022</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		389'575'797.86	421'546'778.25
Ausbezahlte Ausschüttung		-285'963.19	-280'763.10
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-94'787.40	-85'525.91
Saldo aus dem Anteilverkehr		22'600'388.49	27'066'013.55
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		17'857'257.37	-58'670'704.93
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>429'652'693.13</b>	<b>389'575'797.86</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.10.2022 30.09.2023</b>	<b>01.10.2021 30.09.2022</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		7'901.73	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-241.20	-137'430.80
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		2'875'498.19	3'284'461.57
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'024'235.75	713'274.01
Erträge der Gratisaktien		131.64	669.12
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		774'545.82	544'769.80
Erträge aus Rückvergütung		0.00	1'810.09
Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4)		892'092.17	974'669.79
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-48'595.58	-70'626.50
<b>Total Ertrag</b>		<b>5'525'568.52</b>	<b>5'311'597.08</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-2'331.78	-9'419.27
Reglementarische Vergütungen		-4'768'508.44	-4'791'293.55
Sonstige Aufwendungen		-6'133.78	-399.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		25'951.31	34'284.55
<b>Total Aufwand</b>		<b>-4'751'022.69</b>	<b>-4'766'827.27</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>774'545.83</b>	<b>544'769.81</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-991'246.87	6'727'692.82
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		150'368.32	299'626.64
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		94'514.46	42'939.57
Übertrag von steuerrechtlichem Ausgleich aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4)		-892'092.17	-974'669.79
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-863'910.43</b>	<b>6'640'359.05</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		18'721'167.80	-65'311'063.98
<b>Gesamterfolg</b>		<b>17'857'257.37</b>	<b>-58'670'704.93</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse A</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	370'152.28	270'299.78
Vortrag des Vorjahres	62'311.43	68'240.68
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>432'463.71</b>	<b>338'540.46</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	378'741.72	276'229.03
Vortrag auf neue Rechnung	53'721.99	62'311.43
<b>Total</b>	<b>432'463.71</b>	<b>338'540.46</b>

  

<b>Klasse B</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	365'055.30	239'105.12
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>365'055.30</b>	<b>239'105.12</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	127'769.36	83'686.79
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	237'285.94	155'418.33
<b>Total</b>	<b>365'055.30</b>	<b>239'105.12</b>

  

<b>Klasse Ia</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	9'550.05	7'410.06
Vortrag des Vorjahres	467.53	295.22
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>10'017.58</b>	<b>7'705.28</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	9'879.00	7'237.75
Vortrag auf neue Rechnung	138.58	467.53
<b>Total</b>	<b>10'017.58</b>	<b>7'705.28</b>

  

<b>Klasse It</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	29'788.20	27'954.85
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>29'788.20</b>	<b>27'954.85</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	10'425.87	9'784.20
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	19'362.33	18'170.65
<b>Total</b>	<b>29'788.20</b>	<b>27'954.85</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>308'246'828.69</b>	<b>71.68</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>142'900'730.64</b>	<b>33.23</b>	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	13'782	0	0	13'782 EUR	52.51	700'928.73	0.16	a)
<b>BE</b>							<b>700'928.73</b>	<b>0.16</b>	
CA1125851040	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	40'209	4'656	44'865	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1127111075	BROOKFIELD CORP	0	54'038	0	54'038 CAD	42.47	1'552'855.32	0.36	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	10'404	10'404	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	4'809	0	0	4'809 CAD	147.09	478'616.20	0.11	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12'891	0	0	12'891 CAD	52.15	454'873.24	0.11	a)
<b>CA</b>							<b>2'486'344.76</b>	<b>0.58</b>	
CH0002497458	SGS SA-REG	247	0	247	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	5'150	0	0	5'150 CHF	83.95	432'342.50	0.10	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	1'110	0	150	960 CHF	544.20	522'432.00	0.12	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	291	289	40	540 CHF	1'458.00	787'320.00	0.18	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	427	38	61	404 CHF	2'994.00	1'209'576.00	0.28	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	400	103	503	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	427	0	427	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7'262	1'855	1'421	7'696 CHF	420.10	3'233'089.60	0.75	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	96'343	12'769	25'137	83'975 CHF	93.87	7'882'733.25	1.83	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	29'625	4'191	5'326	28'490 CHF	250.45	7'135'320.50	1.66	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	1'550	172	160	1'562 CHF	309.20	482'970.40	0.11	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	42'768	5'964	7'200	41'532 CHF	58.78	2'441'250.96	0.57	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	85'576	6'127	7'000	84'703 CHF	32.80	2'778'258.40	0.65	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	5'619	0	5'619	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	5'116	253	1'402	3'967 CHF	425.60	1'688'355.20	0.39	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2'567	195	310	2'452 CHF	571.60	1'401'563.20	0.33	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1'111	91	150	1'052 CHF	1'034.50	1'088'294.00	0.25	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2'346	421	610	2'157 CHF	261.00	562'977.00	0.13	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	20'637	0	20'637	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0038863350	NESTLE SA-REG	105'707	27'320	19'700	113'327 CHF	103.74	11'756'542.98	2.73	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	0	4'284	0	4'284 CHF	62.05	265'822.20	0.06	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	6'871	0	0	6'871 CHF	94.32	648'072.72	0.15	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	24'292	3'681	4'701	23'272 CHF	112.00	2'606'464.00	0.61	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	9'233	0	0	9'233 CHF	62.30	575'215.90	0.13	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	132'662	10'294	35'386	107'570 CHF	22.69	2'440'763.30	0.57	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	1'620	147	0	1'767 CHF	329.00	581'343.00	0.14	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	0	3'338	0	3'338 CHF	204.40	682'287.20	0.16	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	8'866	833	2'333	7'366 CHF	233.10	1'717'014.60	0.40	a)
CH0432492467	ALCON INC	29'847	4'342	5'029	29'160 CHF	70.94	2'068'610.40	0.48	a)
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	13'232	3'008	2'300	13'940 CHF	51.65	720'001.00	0.17	a)
CH1169360919	ACCELERON INDUSTRIES AG	0	4'279	4'279	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	10'651	0	700	9'951 CHF	117.20	1'166'257.20	0.27	a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	0	4'768	0	4'768 CHF	68.00	324'224.00	0.08	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	2'649	0	2'649 EUR	80.13	205'587.50	0.05	a)
CH1248667003	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG	0	503	0	503 CHF	585.00	294'255.00	0.07	a)
CH1256740924	SGS SA-REG	0	11'554	0	11'554 CHF	77.02	889'889.08	0.21	a)
<b>CH</b>							<b>58'588'833.09</b>	<b>13.62</b>	
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5'121	0	670	4'451 EUR	96.38	415'493.38	0.10	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	20'584	7'547	4'655	23'476 EUR	31.36	712'935.93	0.17	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	4'148	1'062	0	5'210 EUR	158.15	798'043.41	0.19	a)
DE0006969603	PUMA SE	0	5'660	0	5'660 EUR	58.80	322'339.37	0.07	a)
DE0007164600	SAP SE	7'104	663	2'246	5'521 EUR	122.82	656'759.61	0.15	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	8'649	1'700	451	9'898 EUR	135.66	1'300'525.46	0.30	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	3'424	311	0	3'735 EUR	225.70	816'472.88	0.19	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.
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2'380	0	250	2'130 EUR	369.10	761'453.25	0.18	a)
DE000AOLD6E6	GERRESHEIMER AG	0	2'355	0	2'355 EUR	99.45	226'837.73	0.05	a)
DE000A1EWWWO	ADIDAS AG	2'463	0	2'463	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>DE</b>							<b>6'010'861.02</b>	<b>1.40</b>	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	9'433	1'300	10'733	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	11'620	0	11'620 DKK	643.90	971'808.46	0.23	a)
<b>DK</b>							<b>971'808.46</b>	<b>0.23</b>	
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	18'319	0	1'900	16'419 EUR	32.97	524'306.51	0.12	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	17'374	0	5'884	11'490 EUR	35.29	392'727.47	0.09	a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	0	77'000	0	77'000 EUR	3.87	288'467.43	0.07	a)
<b>ES</b>							<b>1'205'501.41</b>	<b>0.28</b>	
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	7'085	650	550	7'185 EUR	159.84	1'112'325.36	0.26	a)
FR0000120321	L'OREAL	0	1'749	0	1'749 EUR	393.20	666'074.67	0.15	a)
FR0000120578	SANOFI	9'567	4'922	950	13'539 EUR	101.48	1'330'719.88	0.31	a)
FR0000120628	AXA SA	40'213	5'700	2'500	43'413 EUR	28.18	1'184'896.41	0.28	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	729	441	0	1'170 EUR	716.40	811'822.41	0.19	a)
FR0000121485	KERING	780	0	93	687 EUR	431.90	287'381.98	0.07	a)
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	2'429	0	604	1'825 EUR	165.16	291'935.79	0.07	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	6'593	700	550	6'743 EUR	156.98	1'025'220.03	0.24	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	16'749	1'300	0	18'049 EUR	27.43	479'510.97	0.11	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	15'985	0	0	15'985 EUR	56.88	880'626.65	0.20	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	9'691	0	5'000	4'691 EUR	60.43	274'560.23	0.06	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	6'281	0	1'006	5'275 EUR	87.30	446'022.02	0.10	a)
FR0014008VX5	EUROAPI SASU	0	34'655	0	34'655 EUR	11.93	400'429.39	0.09	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	12'520	0	0	12'520 EUR	29.07	352'507.98	0.08	a)
<b>FR</b>							<b>9'544'033.77</b>	<b>2.22</b>	
GB0002374006	DIAGEO PLC	31'392	60	7'525	23'927 GBP	3'034.00	810'560.73	0.19	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	947'039	0	0	947'039 GBP	44.37	469'179.49	0.11	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	10'643	1'100	343	11'400 GBP	11'102.00	1'413'148.51	0.33	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	17'717	0	4'800	12'917 GBP	4'062.00	585'845.78	0.14	a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	319'966	0	319'966	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	33'037	0	33'037	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	78'958	0	0	78'958 GBP	389.80	343'652.65	0.08	a)
JE00B783TY65	APTIV PLC	7'593	0	0	7'593 USD	98.59	684'813.67	0.16	a)
<b>GB</b>							<b>4'307'200.83</b>	<b>1.00</b>	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	3'625	0	0	3'625 USD	307.11	1'018'422.83	0.24	a)
IE00BK92Q967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	3'990	0	0	3'990 USD	202.91	740'632.05	0.17	a)
<b>IE</b>							<b>1'759'054.88</b>	<b>0.41</b>	
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	168'542	0	55'843	112'699 EUR	2.44	266'335.76	0.06	a)
IT0001250932	HERA SPA	77'747	0	0	77'747 EUR	2.59	195'030.71	0.05	a)
<b>IT</b>							<b>461'366.47</b>	<b>0.11</b>	
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	2'649	0	2'649	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010273215	ASML HOLDING NV	2'696	0	317	2'379 EUR	559.10	1'288'260.03	0.30	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	57'840	0	0	57'840 EUR	12.55	703'058.73	0.16	a)
<b>NL</b>							<b>1'991'318.76</b>	<b>0.46</b>	
SE0000112724	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	18'300	0	0	18'300 SEK	149.95	231'060.63	0.05	a)
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	14'261	7'478	0	21'739 SEK	238.20	436'023.31	0.10	a)
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23'818	0	5'000	18'818 SEK	235.90	373'791.82	0.09	a)
<b>SE</b>							<b>1'040'875.76</b>	<b>0.24</b>	
US00846U1016	AGILENT TECHNOLOGIES INC	8'557	1'633	1'151	9'039 USD	111.82	924'625.85	0.22	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	27'843	3'466	11'729	19'580 USD	130.86	2'343'936.05	0.55	a)
US0311621009	AMGEN INC	4'529	425	4'954	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0378331005	APPLE INC	36'579	5'745	7'469	34'855 USD	171.21	5'459'091.46	1.27	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	0	18'442	0	18'442 USD	138.45	2'335'754.17	0.54	a)
US0527691069	AUTODESK INC	0	6'000	0	6'000 USD	206.91	1'135'687.61	0.26	a)
US09247X1019	BLACKROCK INC	3'284	604	540	3'348 USD	646.49	1'980'037.51	0.46	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	21'412	7'932	1'426	27'918 USD	58.04	1'482'305.99	0.34	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	0	22'000	0	22'000 USD	53.76	1'081'952.26	0.25	a)
US2310211063	CUMMINS INC	3'839	500	356	3'983 USD	228.46	832'427.91	0.19	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.
US2358511028	DANAHER CORP	8'963	3'899	3'368	9'494 USD	248.10	2'154'776.09	0.50	a)
US2441991054	DEERE & CO	5'279	1'628	1'201	5'706 USD	377.38	1'969'866.54	0.46	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	9'377	10'818	0	20'195 USD	81.05	1'497'348.99	0.35	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	10'984	2'829	1'905	11'908 USD	120.40	1'311'569.98	0.30	a)
US3703341046	GENERAL MILLS INC	13'980	2'940	5'409	11'511 USD	63.99	673'831.52	0.16	a)
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	42'238	0	42'238	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	6'651	1'607	2'063	6'195 USD	302.16	1'712'396.92	0.40	a)
US4581401001	INTEL CORP	15'471	29'415	15'471	29'415 USD	35.55	956'609.33	0.22	a)
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	5'400	3'126	750	7'776 USD	196.75	1'399'578.13	0.33	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	4'464	616	350	4'730 USD	537.13	2'324'163.66	0.54	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	0	5'100	0	5'100 USD	207.84	969'673.36	0.23	a)
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	8'116	1'550	3'288	6'378 USD	190.30	1'110'323.31	0.26	a)
US5745991068	MASCO CORP	11'226	0	11'226	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	28'117	10'488	4'972	33'633 USD	102.95	3'167'510.87	0.74	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	16'377	3'730	4'610	15'497 USD	315.75	4'476'279.01	1.04	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	25'630	4'197	6'482	23'345 USD	69.40	1'482'106.82	0.34	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	21'781	2'893	6'174	18'500 USD	81.67	1'382'166.75	0.32	a)
US6541061031	NIKE INC -CL B	19'911	9'846	2'866	26'891 USD	95.62	2'352'241.18	0.55	a)
US7134481081	PEPSICO INC	5'778	3'045	694	8'129 USD	169.44	1'260'025.17	0.29	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	6'442	616	7'058	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7739031091	ROCKWELL AUTOMATION INC	2'937	450	331	3'056 USD	285.87	799'186.41	0.19	a)
US79466L3024	SALESFORCE INC	5'216	0	1'900	3'316 USD	202.78	615'128.43	0.14	a)
US87612E1064	TARGET CORP	11'795	1'531	9'400	3'926 USD	110.57	397'112.69	0.09	a)
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	5'318	2'014	0	7'332 USD	159.01	1'066'529.94	0.25	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2'855	0	0	2'855 USD	347.74	908'211.34	0.21	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	11'255	2'394	2'860	10'789 USD	230.01	2'270'147.45	0.53	a)
<b>US</b>							<b>53'832'602.70</b>	<b>12.52</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>157'004'664.05</b>	<b>36.51</b>	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	86.25%	86'250.00	0.02	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.85%	888'500.00	0.21	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	1'880	55	0	1'935 CHF	89.30%	1'727'955.00	0.40	a)
<b>AT</b>							<b>2'702'705.00</b>	<b>0.63</b>	
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	750	0	0	750 CHF	96.50%	723'750.00	0.17	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.20%	952'000.00	0.22	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	1'000	0	500	500 CHF	98.92%	494'600.00	0.12	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.45%	904'500.00	0.21	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	97.70%	1'465'500.00	0.34	a)
<b>AU</b>							<b>4'540'350.00</b>	<b>1.06</b>	
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	93.45%	1'401'750.00	0.33	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.21	a)
<b>CA</b>							<b>2'304'250.00</b>	<b>0.54</b>	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	0	1'000	0	1'000 CHF	121.65%	1'216'500.00	0.28	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	40	0	0	40 CHF	100.30%	40'120.00	0.01	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	105	0	105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	0	1'700	0	1'700 CHF	108.79%	1'849'430.00	0.43	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	750	0	0	750 CHF	97.80%	733'500.00	0.17	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	0	500	0	500 CHF	99.80%	499'000.00	0.12	a)
CH0254147504	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 09/28/29	1'500	0	0	1'500 CHF	98.15%	1'472'250.00	0.34	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	800	0	0	800 CHF	96.40%	771'200.00	0.18	a)
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	0	2'500	0	2'500 CHF	96.47%	2'411'750.00	0.56	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	65	0	0	65 CHF	90.50%	58'825.00	0.01	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	500	0	0	500 CHF	92.95%	464'750.00	0.11	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	150	0	0	150 CHF	93.25%	139'875.00	0.03	a)
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	115	0	0	115 CHF	90.80%	104'420.00	0.02	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	1'600	0	0	1'600 CHF	86.50%	1'384'000.00	0.32	a)
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	200	0	200 CHF	93.20%	186'400.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELL SW 0 5/8 03/24/25	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	650	0	0	650 CHF	89.33%	580'645.00	0.14	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	1'500	0	0	1'500 CHF	92.40%	1'386'000.00	0.32	a)
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN	400	0	0	400 CHF	99.07%	396'280.00	0.09	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	25	0	25	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	2'000	0	200	1'800 CHF	96.10%	1'729'800.00	0.40	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213904	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 07/04/23	350	0	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	400	0	0	400 CHF	96.90%	387'600.00	0.09	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMNVX 0 1/8 09/15/32	160	0	0	160 CHF	85.80%	137'280.00	0.03	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	100	0	0	100 CHF	87.61%	87'610.00	0.02	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	0	100	0	100 CHF	86.70%	86'700.00	0.02	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	500	0	200	300 CHF	94.60%	283'800.00	0.07	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	500	0	200	300 CHF	96.50%	289'500.00	0.07	a)
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	500	0	200	300 CHF	95.81%	287'430.00	0.07	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	1'500	0	0	1'500 CHF	92.72%	1'390'800.00	0.32	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476032	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 12/08/25 0	1'000	0	0	1'000 CHF	96.80%	968'000.00	0.23	a)
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	800	0	0	800 CHF	95.60%	764'800.00	0.18	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	1'000	0	300	700 CHF	97.65%	683'550.00	0.16	a)
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	750	0	0	750 CHF	93.90%	704'250.00	0.16	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	1'000	0	0	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.22	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	94.60%	946'000.00	0.22	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	750	0	250	500 CHF	98.30%	491'500.00	0.11	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'500	0	300	1'200 CHF	95.89%	1'150'680.00	0.27	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	500	0	0	500 CHF	94.24%	471'200.00	0.11	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	1'000	0	0	1'000 CHF	95.20%	952'000.00	0.22	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	400	0	0	400 CHF	94.60%	378'400.00	0.09	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	1'400	0	0	1'400 CHF	91.55%	1'281'700.00	0.30	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	1'000	0	0	1'000 CHF	88.65%	886'500.00	0.21	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	2'000	0	0	2'000 CHF	84.95%	1'699'000.00	0.40	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMNVX 0 1/2 03/15/29	1'500	0	0	1'500 CHF	93.30%	1'399'500.00	0.33	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'370	0	0	1'370 CHF	86.75%	1'188'475.00	0.28	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	2'000	1'000	0	3'000 CHF	91.23%	2'736'900.00	0.64	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	1'000	0	0	1'000 CHF	93.10%	931'000.00	0.22	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	1'000	0	0	1'000 CHF	93.95%	939'500.00	0.22	a)
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	750	0	50	700 CHF	95.25%	666'750.00	0.16	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	1'000	400	1'000	400 CHF	95.10%	380'400.00	0.09	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	1'000	0	0	1'000 CHF	83.74%	837'400.00	0.19	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	750	0	0	750 CHF	87.00%	652'500.00	0.15	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	200	0	0	200 CHF	82.50%	165'000.00	0.04	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	0	200	0	200 CHF	89.85%	179'700.00	0.04	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	110	0	0	110 CHF	86.75%	95'425.00	0.02	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	1'500	0	0	1'500 CHF	93.15%	1'397'250.00	0.32	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	3'100	0	0	3'100 CHF	90.60%	2'808'600.00	0.65	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'350	0	0	1'350 CHF	88.80%	1'198'800.00	0.28	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	670	0	0	670 CHF	85.05%	569'835.00	0.13	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	2'525	0	0	2'525 CHF	87.60%	2'211'900.00	0.51	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	1'000	0	0	1'000 CHF	89.60%	896'000.00	0.21	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'040	0	0	1'040 CHF	92.25%	959'400.00	0.22	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	2'000	0	0	2'000 CHF	85.35%	1'707'000.00	0.40	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	1'800	0	0	1'800 CHF	88.85%	1'599'300.00	0.37	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	70	0	0	70 CHF	82.35%	57'645.00	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.
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	1'000	0	0	1'000 CHF	90.30%	903'000.00	0.21	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	1'500	0	0	1'500 CHF	95.00%	1'425'000.00	0.33	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	925	0	0	925 CHF	84.00%	777'000.00	0.18	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	1'000	0	300	700 CHF	96.65%	676'550.00	0.16	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	620	0	0	620 CHF	81.75%	506'850.00	0.12	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	1'200	0	200	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.23	a)
CH0557778781	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33 APRL	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	1'000	0	0	1'000 CHF	85.50%	855'000.00	0.20	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	830	0	0	830 CHF	86.30%	716'290.00	0.17	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	2'000	0	0	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.42	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	0	1'000	0	1'000 CHF	86.35%	863'500.00	0.20	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'500	0	0	1'500 CHF	92.50%	1'387'500.00	0.32	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	970	0	0	970 CHF	92.70%	899'190.00	0.21	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	2'000	0	0	2'000 CHF	91.45%	1'829'000.00	0.43	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	500	0	50	450 CHF	94.05%	423'225.00	0.10	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	1'000	0	0	1'000 CHF	89.55%	895'500.00	0.21	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	2'000	0	0	2'000 CHF	91.75%	1'835'000.00	0.43	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	1'750	0	0	1'750 CHF	83.55%	1'462'125.00	0.34	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	0	1'000	0	1'000 CHF	83.70%	837'000.00	0.19	a)
CH0593641050	1.2500 % MEDCLI 1 1/4 02/25/26	1'300	0	0	1'300 CHF	97.20%	1'263'600.00	0.29	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	0	500	0	500 CHF	87.55%	437'750.00	0.10	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	2'000	0	200	1'800 CHF	94.45%	1'700'100.00	0.40	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'000	0	0	1'000 CHF	89.20%	892'000.00	0.21	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMN VX 0 1/4 05/18/33	350	0	0	350 CHF	85.55%	299'425.00	0.07	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	1'500	0	0	1'500 CHF	87.90%	1'318'500.00	0.31	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	700	0	0	700 CHF	85.20%	596'400.00	0.14	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	90.90%	1'181'700.00	0.27	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	500	0	0	500 CHF	93.25%	466'250.00	0.11	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	1'500	0	0	1'500 CHF	94.65%	1'419'750.00	0.33	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	1'400	0	200	1'200 CHF	94.90%	1'138'800.00	0.26	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	2'000	0	0	2'000 CHF	91.70%	1'834'000.00	0.43	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.22	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	750	0	0	750 CHF	95.65%	717'375.00	0.17	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	0	600	0	600 CHF	97.15%	582'900.00	0.14	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	0	1'500	0	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.34	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	190	0	0	190 CHF	95.60%	181'640.00	0.04	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	0	1'000	0	1'000 CHF	98.36%	983'600.00	0.23	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	0	1'000	0	1'000 CHF	98.55%	985'500.00	0.23	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	0	1'000	0	1'000 CHF	102.55%	1'025'500.00	0.24	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	0	1'000	0	1'000 CHF	106.20%	1'062'000.00	0.25	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	150	0	150 CHF	99.75%	149'625.00	0.03	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	0	1'000	0	1'000 CHF	100.55%	1'005'500.00	0.23	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	500	0	0	500 CHF	96.50%	482'500.00	0.11	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	0	2'920	0	2'920 CHF	101.75%	2'971'100.00	0.69	a)
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.24	a)
CH1218302029	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 NOV	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218302037	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	0	600	0	600 CHF	99.80%	598'800.00	0.14	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	0	500	0	500 CHF	102.65%	513'250.00	0.12	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	1'500	0	1'500 CHF	101.45%	1'521'750.00	0.35	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	0	2'000	0	2'000 CHF	101.60%	2'032'000.00	0.47	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	0	1'400	0	1'400 CHF	99.70%	1'395'800.00	0.32	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	0	1'000	0	1'000 CHF	100.30%	1'003'000.00	0.23	a)
CH1239464543	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 FEB	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464618	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464626	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	500	0	500 CHF	102.75%	513'750.00	0.12	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	0	1'500	0	1'500 CHF	99.89%	1'498'350.00	0.35	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	0	1'700	0	1'700 CHF	100.60%	1'710'200.00	0.40	a)
CH1239495000	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 JAN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1242301286	2.6100 % SLHNX 2.61 01/26/32	0	350	0	350 CHF	103.30%	361'550.00	0.08	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	0	600	0	600 CHF	100.55%	603'300.00	0.14	a)
CH1243651960	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 FEB	0	1'920	1'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	0	1'000	0	1'000 CHF	101.40%	1'014'000.00	0.24	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	500	0	500 CHF	100.56%	502'800.00	0.12	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	500	0	500 CHF	99.76%	498'800.00	0.12	a)
CH1280154316	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 SEP	0	500	0	500 CHF	96.72%	483'585.00	0.11	a)
<b>CH</b>							<b>113'724'005.00</b>	<b>26.44</b>	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	92.50%	1'387'500.00	0.32	a)
<b>CL</b>							<b>1'387'500.00</b>	<b>0.32</b>	
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	89.70%	1'345'500.00	0.31	a)
CH0511961390	1.5000 % OTTOGR 1 1/2 12/09/24 EMTN	2'000	0	500	1'500 CHF	97.50%	1'462'500.00	0.34	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.00%	1'900'000.00	0.44	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.50%	1'810'000.00	0.42	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.70%	907'000.00	0.21	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	92.45%	1'479'200.00	0.34	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	85.35%	1'707'000.00	0.40	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	2'850	0	0	2'850 CHF	85.70%	2'442'450.00	0.57	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	500	0	0	500 CHF	88.45%	442'250.00	0.10	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	0	1'350	0	1'350 CHF	99.75%	1'346'625.00	0.31	a)
<b>DE</b>							<b>14'842'525.00</b>	<b>3.45</b>	
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.90%	949'000.00	0.22	a)
<b>FI</b>							<b>949'000.00</b>	<b>0.22</b>	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	94.85%	1'185'625.00	0.28	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	88.15%	88'150.00	0.02	a)
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'970	0	0	1'970 CHF	85.50%	1'684'350.00	0.39	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.80%	1'497'000.00	0.35	a)
FR0013419736	1.0000 % CAFP 1 05/17/27 EMTN	800	0	0	800 EUR	89.99%	697'282.33	0.16	a)
<b>FR</b>							<b>5'152'407.33</b>	<b>1.20</b>	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0488506699	0.1250 % NWG 0 1/8 09/13/23 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBC38	2.9500 % VOD 2.95 02/19/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>GB</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	86.35%	1'727'000.00	0.40	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	0	800	0	800 CHF	101.20%	809'600.00	0.19	a)
<b>LI</b>							<b>2'536'600.00</b>	<b>0.59</b>	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.23	a)
<b>LU</b>							<b>972'500.00</b>	<b>0.23</b>	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	0	600	0	600 CHF	85.10%	510'600.00	0.12	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	91.60%	1'465'600.00	0.34	a)
US21685WDF14	3.9500 % RABOBK 3.95 11/09/22	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2082345955	0.6250 % CCHLN 0 5/8 11/21/29	300	0	0	300 EUR	81.73%	237'489.06	0.06	a)
<b>NL</b>							<b>2'213'689.06</b>	<b>0.51</b>	
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	400	0	0	400 CHF	90.20%	360'800.00	0.08	a)
<b>NO</b>							<b>360'800.00</b>	<b>0.08</b>	
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'250	0	250	1'000 CHF	96.40%	964'000.00	0.22	a)
<b>NZ</b>							<b>964'000.00</b>	<b>0.22</b>	
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	750	0	0	750 CHF	98.50%	738'750.00	0.17	a)
US002824BP42	1.1500 % ABT 1.15 01/30/28	500	0	0	500 USD	85.14%	389'448.66	0.09	a)
US02079KAD90	1.1000 % GOOGL 1.1 08/15/30	500	0	0	500 USD	77.75%	355'605.63	0.08	a)
US459200JC60	2.8750 % IBM 2 7/8 11/09/22	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	500	0	0	500 USD	80.20%	366'848.52	0.09	a)
USU74078BX05	3.3500 % NESNVX 3.35 09/24/23 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1028941117	1.8750 % MRK 1 7/8 10/15/26	600	0	0	600 EUR	94.42%	548'717.29	0.13	a)
XS1513055555	0.5000 % MRK 0 1/2 11/02/24	500	0	0	500 EUR	96.37%	466'712.56	0.11	a)
<b>US</b>							<b>2'866'082.66</b>	<b>0.67</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'500	0	0	1'500 CHF	92.00%	1'380'000.00	0.32	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	125	0	0	125 CHF	86.60%	108'250.00	0.03	a)
<b>XS</b>							<b>1'488'250.00</b>	<b>0.35</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
FR001400GCH7	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP	0	1'825	1'825	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150016G8	UNILEVER PLC-RIGHT	0	177	177	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001BD9	UNILEVER PLC	0	17'717	17'717	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001F19	UNILEVER PLC-DRIP	0	12'917	12'917	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001L26	UNILEVER PLC	0	12'917	12'917	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>8'341'434.00</b>	<b>1.94</b>	
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	10'500	500	600	10'400 CHF	201.00	2'090'400.00	0.49	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	28'300	3'500	1'000	30'800 CHF	77.60	2'390'080.00	0.56	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	0	12'800	0	12'800 CHF	59.80	765'440.00	0.18	a)
CH0105994401	UBS ETF SXI REAL ESTATE FU.	262'000	4'000	8'000	258'000 CHF	8.28	2'137'014.00	0.50	a)
CH0245633950	CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A	7'700	0	7'700	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	7'000	0	250	6'750 CHF	142.00	958'500.00	0.22	a)
<b>CH</b>							<b>8'341'434.00</b>	<b>1.94</b>	
<b>Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>							<b>114'618'193.25</b>	<b>26.65</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>114'618'193.25</b>	<b>26.65</b>	
CH0011292288	PICTET CH-SHRT TR MKT CH-JDY	0	61'137	3'437	57'700 CHF	877.72	50'644'444.00	11.78	a)
<b>CH</b>							<b>50'644'444.00</b>	<b>11.78</b>	
IE00BFZMJ750	BNY-SUSTAIN GLOBAL DY-W CHFH	4'410'000	0	0	4'410'000 CHF	0.91	4'010'454.00	0.93	a)
IE00BQ1YBP44	COMGEST GROWTH JAPAN-YEN IA	344'115	187'000	1'227	529'888 JPY	1'689.00	5'486'536.79	1.28	a)
<b>IE</b>							<b>9'496'990.79</b>	<b>2.21</b>	
LI0183909840	LGTQUFD-SQBDFH CHI1	4'410	0	4'410	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>LI</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
LU0384410279	VF-MTX SUST ASIA L XJ-IUSD	41'803	4'500	150	46'153 USD	382.65	16'155'775.50	3.76	a)
LU0772947080	NORDEA 1-EURO CON BD-HBICHF	0	522'000	0	522'000 CHF	14.91	7'780'723.20	1.81	a)
LU0816333479	LGT-CAT BD-CHF B2	131'500	0	131'500	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU0837979243	ABERDEEN GL-LATIN AM EQ-X2AC	253'762	20'000	0	273'762 USD	8.28	2'073'346.83	0.48	a)
LU1050624433	RESPONSABILITY GB MIC HIICHF	103'500	0	103'500	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU1079060700	BLUEORCHARD MICROFIN DB-NCHH	0	567	0	567 CHF	11'345.30	6'432'785.10	1.50	a)
LU1434526627	CANDRIAM SUST EQ JAP-CDISJPY	3'851	1'520	14	5'357 JPY	192'971.00	6'337'212.29	1.47	a)
LU2168313653	LGT-CAT BOND FUND-CHF C2	0	147'819	0	147'819 CHF	106.19	15'696'915.54	3.65	a)
LU2212002096	ASSENAGON CREDIT SELECTION ESG-I25C	3'640	0	3'640	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>54'476'758.46</b>	<b>12.67</b>	
<b>Nicht kotierte Wertpapiere</b>							<b>3'059'679.48</b>	<b>0.71</b>	
<b>Strukturierte Produkte</b>							<b>3'059'679.48</b>	<b>0.71</b>	
CH0506568150	ZKB TRACKER-ZERTIFIKAT DYN. AUF BLKB KLIMA BASKET	3'081	0	0	3'081 CHF	993.08	3'059'679.48	0.71	a)
<b>CH</b>							<b>3'059'679.48</b>	<b>0.71</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-119'341.87</b>	<b>-0.03</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	EUR/CHF Verfall 25.11.2022		1'918'580	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.11.2022		4'323'150	4'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 17.02.2023		1'954'000	2'000'000	CHF/EUR		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.
	USD/CHF Verfall 17.02.2023		3'004'800	3'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.05.2023		2'014'430	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.05.2023		1'965'600	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.08.2023		1'936'300	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.08.2023		1'964'600	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.11.2023		1'893'700	2'000'000		CHF/EUR	-36'647.34	-0.01	b)
	USD/CHF Verfall 24.11.2023		1'918'235	2'200'000		CHF/USD	-82'694.53	-0.02	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-119'341.87</b>	<b>-0.03</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'060'362.33	0.71
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	142'900'730.64	33.23
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	157'004'664.05	36.51
Strukturierte Produkte	3'059'679.48	0.71
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	122'959'627.25	28.59
Derivative Finanzinstrumente	-119'341.87	-0.03
Sonstige Vermögenswerte	1'182'911.25	0.28
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>430'048'633.13</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-395'940.00	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>429'652'693.13</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);	425'924'701.42	99.04
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-119'341.87	-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

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

CAD	1 = CHF	0.67662722
DKK	100 = CHF	12.98841400
EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
JPY	100 = CHF	0.61303400
SEK	100 = CHF	8.42031600
USD	1 = CHF	0.91480000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	3'949'649.08	0.919
Netto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	-	-
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## 5 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
A	CHF	-	-	-	-
B	CHF	-	-	-	-
la	CHF	-	-	-	-
lt	CHF	-	-	-	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Max
A	1.150	1.550	4.000
B	1.150	1.550	4.000
la	0.600	0.700	4.000
lt	0.600	0.700	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.

## 8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 9 TER

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

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 12.12.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 15.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Nein	CHF	0.20000	0.07000	0.13000
la	Nein	CHF	0.70000	0.24500	0.45500

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 12.12.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 15.12.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
B	Nein	CHF	0.18868	0.06603	0.12265
lt	Nein	CHF	0.68747	0.24061	0.44686

## 12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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.
- 4) Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenössischen Steuerverwaltung.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimiten (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimiten zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert der Teilvermögen 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 jeweiligen Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens 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, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbare Bewertungsmodelle und -grundsätze nach Treu und Glauben an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt:  
Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen 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 1% 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 einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen 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 Fällen 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 Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem 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 Nettofondsvermögen, getätigt wurden.



## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### **BLKB Next Generation Strategy**

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

mit den Teilvermögen

BLKB Next Generation Fund Yield

BLKB Next Generation Fund Balanced

BLKB Next Generation Fund Growth

BLKB Next Generation Fund Equity

(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

Das Klassenkonzept wird um eine Anteilsklasse erweitert, vgl. Ziff. 1 dieser Mitteilung.

Neu wird die Möglichkeit der Sacheinlage und -auslage aufgenommen, vgl. Ziff. 2 dieser Mitteilung.

Die Anlagepolitik erfährt generell und bezogen auf die Teilvermögen Anpassungen, vgl. Ziff. 3 dieser Mitteilung.

Schliesslich erfolgen betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen Präzisierungen, vgl. Ziff. 4 dieser Mitteilung.

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

### **1. Erweiterung Klassenkonzept**

Das Klassenkonzept wird um die Anteilsklasse Zt ergänzt. Die Referenzwährung der Anteilsklasse Zt entspricht der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens (vgl. § 6 Ziff. 4 des geänderten Fondsvertrages).

Der Anlegerkreis der Anteilsklasse Zt setzt sich wie folgt zusammen (vgl. § 6 Ziff. 4 des geänderten Fondsvertrages):

*"Anteile der Zt Klasse sind thesaurierende Anteile und stehen professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a bis i FIDLEG offen, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren individuellen Dienstleistungsvertrag (zum Beispiel eine individuelle Investitionsvereinbarung oder ein individueller Vermögensverwaltungsvertrag) mit der Basellandschaftlichen Kantonalbank abgeschlossen haben.*

*Die Fondsleitung wird für die Fondsverwaltung (d.h. die Leitung, die Vermögensverwaltung und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank) nicht über die Verwaltungskommission, sondern über eine Vergütung entschädigt, die im Rahmen des individuellen Dienstleistungsvertrages zwischen dem Anleger auf der einen Seite und der Basellandschaftlichen Kantonalbank auf der anderen Seite festgelegt wird.*

*Im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG stehen den vorerwähnten Anlegern Anteile der Zt Klasse nicht zur Verfügung."*

Unter § 19 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages wird betreffend die Vergütung und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen darauf hingewiesen, dass die Fondsleitung über eine Vergütung entschädigt wird, die im Rahmen des individuellen Dienstleistungsvertrages zwischen dem Anleger auf der einen Seite und der Basellandschaftlichen Kantonalbank auf der anderen Seite festgelegt wird.

## **2. Aufnahme von Sacheinlage und -auslage**

Unter § 1 Ziff. 5 ist festgehalten, dass die Teilvermögen von der Pflicht zur Ein- und Auszahlung in bar befreit sind. Neu werden im geänderten Fondsvertrag die Bestimmungen betreffend Sacheinlage und -auslage in den nachfolgend aufgeführten Paragraphen aufgenommen, so dass Anleger Anträge für Sacheinlagen und Sachauslagen stellen können.

Unter § 5 des geänderten Fondsvertrages werden Ergänzungen in den Bestimmungen unter Ziff. 2, 4, 5 und 6 betreffend Sacheinlage und -auslage vorgenommen.

Anstelle der Einzahlung in bar soll neu auf Antrag des Anlegers und mit Zustimmung der Fondsleitung eine Sacheinlage vorgenommen werden können (vgl. ergänzte Bestimmung von § 5 Ziff. 2 des geänderten Fondsvertrages):

*"Die Anleger erwerben mit Vertragsabschluss und der Einzahlung in bar eine Forderung gegen die Fondsleitung auf Beteiligung am Vermögen und am Ertrag eines Teilvermögens des Umbrella-Fonds. Anstelle der Einzahlung in bar kann auf Antrag des Anlegers und mit Zustimmung der Fondsleitung eine Sacheinlage gemäss den Bestimmungen von § 17 Ziff. 7 vorgenommen werden. Die Forderung der Anleger ist in Anteilen begründet."*

Bei einer Sacheinlage sind die Anleger nicht zu einer Einzahlung im Umfang des von ihnen gezeichneten Anteils, sondern zur Leistung der Sacheinlage im Umfang des von ihnen gezeichneten Anteils verpflichtet (vgl. ergänzte Bestimmung von § 5 Ziff. 4 des geänderten Fondsvertrages):

*"Die Anleger sind nur zur Einzahlung bzw. zur Leistung der Sacheinlage im Umfang des von ihnen gezeichneten Anteils in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet. Ihre persönliche Haftung für Verbindlichkeiten des Umbrella-Fonds bzw. Teilvermögens ist ausgeschlossen."*

Betreffend die Auskunft der Anleger wird § 5 Ziff. 5 ebenfalls um Sacheinlagen bzw. -auslagen wie folgt ergänzt:

*"Die Anleger erhalten bei der Fondsleitung jederzeit Auskunft über die Grundlagen für die Berechnung des Nettoinventarwertes pro Anteil. Machen die Anleger ein Interesse an näheren Angaben über einzelne Geschäfte der Fondsleitung wie die Ausübung von Mitgliedschafts- und Gläubigerrechten, über das Riskmanagement oder über Sacheinlagen bzw. -auslagen geltend, so erteilt ihnen die Fondsleitung auch darüber jederzeit Auskunft. Die Anleger können beim Gericht am Sitz der Fondsleitung verlangen, dass die Prüfgesellschaft oder eine andere sachverständige Person den abklärungsbedürftigen Sachverhalt untersucht und ihnen darüber Bericht erstattet."*

Bis anhin war die Auszahlung in Anlagen ausgeschlossen. Diese Aussage wird gestrichen und die Bestimmung wird um den Hinweis der Sachauslage ergänzt (vgl. § 5 Ziff. 6 des geänderten Fondsvertrages):

*"Die Anleger können den Fondsvertrag jederzeit kündigen und die Auszahlung ihres Anteils am entsprechenden Teilvermögen in bar verlangen. Anstelle der Auszahlung in bar kann auf Antrag des Anlegers und mit Zustimmung der Fondsleitung eine Sachauslage gemäss den Bestimmungen von § 17 Ziffer 7 vorgenommen werden."*

Unter § 17 des geänderten Fondsvertrages wird eine neue Ziff. 7 betreffend Sacheinlage und -auslage aufgenommen. Diese lautet neu wie folgt:

*"Jeder Anleger kann beantragen, dass er im Falle einer Zeichnung anstelle einer Einzahlung in bar Anlagen an das Fondsvermögen des jeweiligen Teilvermögens leistet („Sacheinlage“ oder „contribution in kind“ genannt) bzw. dass ihm im Falle einer Kündigung anstelle einer Auszahlung in bar Anlagen übertragen werden („Sachauslage“ oder „redemption in kind“). Der Antrag ist zusammen mit der Zeichnung bzw. Rücknahme zu stellen. Die Fondsleitung ist nicht verpflichtet, Sachein- und Sachauslagen zuzulassen.*

*Die Anzahl Anteile, auf die ein Anleger aufgrund seiner Zeichnung durch Sacheinlage bzw. die Anlagen, auf die ein Anleger aufgrund seiner Kündigung durch Sachauslage Anspruch hat, wird nicht aufgrund des modifizierten Nettoinventarwertes pro Anteil, sondern aufgrund des Bewertungs-Nettoinventarwertes pro Anteil für einen bestimmten Bewertungstag ermittelt (vgl. § 16 Ziff. 6 des Fondsvertrages).*

*Die Fondsleitung entscheidet allein über Sacheinlagen oder Sachauslagen und stimmt solchen Geschäften nur zu, sofern die Ausführung der Transaktionen vollumfänglich im Einklang mit der Anlagepolitik des jeweiligen Teilvermögens steht und die Interessen der übrigen Anleger dadurch nicht beeinträchtigt werden.*

*Die im Zusammenhang mit einer Sacheinlage oder Sachauslage anfallenden Kosten dürfen nicht dem Fondsvermögen belastet werden.*

*Die Fondsleitung erstellt bei Sacheinlagen oder Sachauslagen einen Bericht, der Angaben zu den einzelnen übertragenen Anlagen, dem Kurswert dieser Anlagen am Stichtag der Übertragung, die Anzahl der als Gegenleistung ausgegebenen Anteile und einen allfälligen Spitzenausgleich in bar enthält. Sacheinlagen und Sachauslagen werden zum Bewertungs-Nettoinventarwert abgerechnet. Die Depotbank prüft bei jeder Sacheinlage oder Sachauslage die Einhaltung der Treuepflicht durch die Fondsleitung sowie die Bewertung der übertragenen Anlagen und der ausgegebenen Anteile bzw. zurückgenommenen Anteile, bezogen auf den massgeblichen Stichtag. Die Depotbank meldet Vorbehalte oder Beanstandungen unverzüglich der Prüfgesellschaft.*

*Sacheinlage- und Sachauslagetransaktionen sind im Jahresbericht zu nennen."*

Sodann wird unter § 24 Ziff. 5 darauf hingewiesen, dass die Anleger neu auch einen Antrag auf Sachauslage gemäss § 17 Ziff. 7 stellen können. Der Wortlaut der ergänzten Bestimmung lautet wie folgt:

*"Die Fondsleitung publiziert die beabsichtigten Änderungen des Fondsvertrages nach § 23 Ziff. 1 sowie die beabsichtigte Vereinigung und deren Zeitpunkt zusammen mit dem Vereinigungsplan mindestens zwei Monate vor dem von ihr festgelegten Stichtag in den Publikationsorganen der beteiligten Teilvermögen bzw. Anlagefonds. Dabei weist sie die Anleger darauf hin, dass diese bei der Aufsichtsbehörde innert 30 Tagen nach der letzten Publikation Einwendungen gegen die beabsichtigten Änderungen des Fondsvertrages erheben oder die Rückzahlung ihrer Anteile in bar verlangen bzw. den Antrag auf Sachauslage gemäss § 17 Ziff. 7 stellen können."*

### **3. Anpassung Anlagepolitik**

#### **3.1. Generelle Anpassungen**

Neu wird § 8 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages mit der Überschrift "Zulässige Anlagen", § 8 Ziff. 2 mit der Überschrift "Anlageziel und Anlagepolitik der Teilvermögen" und § 8 Ziff. 4 mit der Überschrift "Liquiditätsmanagement" versehen.

#### **3.2. Teilfondsspezifische Anpassungen im Besonderen Teil des Fondsvertrages**

##### **BLKB Next Generation Fund Yield**

Die Bestimmung von § 29A Ziff. 5 lit. a, wonach das Teilvermögen insgesamt höchstens 35% des Vermögens des Teilvermögens in Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen investieren kann, wird ersatzlos gestrichen, weil das Teilvermögen neu bis 70% des Vermögens indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte über den Zielfonds BLKB

Bond CHF<sup>1</sup> investieren kann. Aufgrund dieser Streichung ändern sich die alphanumerischen Bezeichnungen unter § 29A Ziff. 5 sowie der Verweis in der Bestimmung von Ziff. 6. Der Verweis unter Ziff. 6 bezieht sich neu auf Ziff. 5 lit. g (bisher Ziff. 5 lit. h).

Weiter wird die beispielhafte Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente unter Forderungswertpapieren und -wertrechten unter § 29A Ziff. 3 und 5 lit. c (bisher lit. d) neu um Bail-in Bonds ergänzt.

Der Wortlaut von § 29A Ziff. 3 lautet neu wie folgt:

*"Die Fondsleitung investiert zudem höchstens 90% des Vermögens des Teilvermögens direkt und/oder indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS, Senior Secured Loans sowie Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds u.Ä.) gemäss § 8 Ziff. 1 lit. a sowie Geldmarktinstrumente gemäss § 8 Ziff. 1 lit. e.*

*Bis höchstens 70% des Vermögens des Teilvermögens können über den Zielfonds BLKB Bond CHF des Umbrella-Fonds BLKB Selection (CH) indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte investiert werden. Bezüglich der damit verbundenen Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen.*

*Bei Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 1 lit. d, einschliesslich alternativer Anlagen gemäss § 8 Ziff. 1 lit. i, Derivate gemäss § 8 Ziff. 1 lit. b und auf eine konvertierbare Währung lautende strukturierte Produkte gemäss § 8 Ziff. 1 lit. c, Indexzertifikate und Indexbaskets stellt die Fondsleitung sicher, dass die Maximalanteile auf konsolidierter Basis beachtet werden."*

### BLKB Next Generation Fund Balanced

Die Bestimmung von § 29B Ziff. 5 lit. a, wonach das Teilvermögen insgesamt höchstens 35% des Vermögens des Teilvermögens in Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen investieren kann, wird ersatzlos gestrichen, weil das Teilvermögen neu bis 70% des Vermögens indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte über den Zielfonds BLKB Bond CHF<sup>1</sup> investieren kann. Aufgrund dieser Streichung ändert sich die alphanumerische Bezeichnung von § 29B Ziff. 5 sowie der Verweis in Ziff. 6. Der Verweis unter Ziff. 6 bezieht sich neu auf Ziff. 5 lit. g (bisher Ziff. 5 lit. h).

Weiter wird die beispielhafte Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente unter Forderungswertpapieren und -wertrechten unter § 29B Ziff. 3 und 5 lit. c (bisher lit. d) neu um Bail-in Bonds ergänzt.

Der Wortlaut von § 29B Ziff. 3 lautet neu wie folgt:

*"Die Fondsleitung investiert zudem höchstens 80% des Vermögens des Teilvermögens direkt und/oder indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS, Senior Secured Loans sowie Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds u.Ä.) gemäss § 8 Ziff. 1 lit. a sowie Geldmarktinstrumente gemäss § 8 Ziff. 1 lit. e.*

*Bis höchstens 70% des Vermögens des Teilvermögens können über den Zielfonds BLKB Bond CHF des Umbrella-Fonds BLKB Selection (CH) indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte investiert werden. Bezüglich der damit verbundenen Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen.*

*Bei Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 1 lit. d, einschliesslich alternativer Anlagen gemäss § 8 Ziff. 1 lit. i, Derivate gemäss § 8 Ziff. 1 lit. b und auf eine konvertierbare Währung lautende strukturierte Produkte gemäss § 8 Ziff. 1 lit. c, Indexzertifikate und Indexbaskets stellt die Fondsleitung sicher, dass die Maximalanteile auf konsolidierter Basis beachtet werden."*

---

<sup>1</sup> Das Teilvermögen BLKB Bond CHF des Umbrella-Fonds BLKB Selection CH wird Mitte Juni 2023 im Rahmen eines Erstbewilligungsgesuchs bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA eingereicht.

## BLKB Next Generation Fund Growth

Die Bestimmung von § 29C Ziff. 5 lit. i, wonach das Teilvermögen insgesamt höchstens 49% des Vermögens des Teilvermögens in Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen investieren kann, wird ersatzlos gestrichen, weil das Teilvermögen neu bis 55% des Vermögens indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte über den Zielfonds BLKB Bond CHF<sup>1</sup> investieren kann. Aufgrund dieser Streichung ändert sich die alphanumerische Bezeichnung von § 29C Ziff. 5 lit. j in neu lit. i und der Verweis in Ziff. 7 bezieht sich neu auf Ziff. 5 lit. i (bisher lit. j).

Weiter wird die beispielhafte Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente unter Forderungswertpapieren und -wertrechten unter § 29C Ziff. 3 und 5 lit. g neu um Bail-in Bonds ergänzt.

Der Wortlaut von § 29C Ziff. 3 lautet neu wie folgt:

*"Die Fondsleitung investiert zudem höchstens 55% des Vermögens des Teilvermögens direkt und/oder indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen sowie Schuldverschreibung die durch Anlagen besichert sind, wie Pfandbriefe, ABS, MBS, Senior Secured Loans sowie Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds u.Ä.) gemäss § 8 Ziff. 1 lit. a von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldern weltweit.*

*Bis höchstens 55% des Vermögens des Teilvermögens können über den Zielfonds BLKB Bond CHF des Umbrella-Fonds BLKB Selection (CH) indirekt in Forderungswertpapiere und -wertrechte investiert werden. Bezüglich der damit verbundenen Risiken wird auf § 15 Ziff. 8 verwiesen."*

## BLKB Next Generation Fund Equity

Bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente unter Forderungswertpapieren und -wertrechten werden die Bestimmungen von § 29D Ziff. 4 lit. a und Ziff. 5 lit. h neu um Bail-in Bonds ergänzt. Der Wortlaut von § 29D Ziff. 4 lit. a lautet neu wie folgt:

*"direkte und/oder indirekte Anlagen in Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS, Senior Secured Loans sowie Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds u. Ä.) gemäss § 8 Ziff. 1 lit. a von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldern weltweit;"*

## 4. Anpassung Risikoverteilung

Entsprechend der Aufnahme des Teilvermögens BLKB Selection (CH)<sup>1</sup> als Zielfonds in der teilfondsspezifischen Anlagepolitik im Besonderen Teil A bis C des geänderten Fondsvertrages wird auch die Risikoverteilung unter § 15 Ziff. 8 um die folgende Bestimmung ergänzt:

*"Die beiden Teilvermögen BLKB Next Generation Fund Yield und BLKB Next Generation Fund Balanced können als Dachfonds je bis zu 70% und das Teilvermögen BLKB Next Generation Fund Growth kann als Dachfonds bis zu 55% des Vermögens in den Zielfonds BLKB Bond CHF des Umbrella-Fonds BLKB Selection (CH) investieren. Jeder dieser Dachfonds darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften bis 100% der Anteile des Zielfonds erwerben. Die effektiv investierten Volumen sind in den Jahres- und Halbjahresberichten der Dach- und Zielfonds ausgewiesen.*

*Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die betreffenden Dachfonds, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die Rückgabe durch den oder die Dachfonds zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme*

durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung an den oder die Dachfonds wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen."

## 5. Präzisierung Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen wird mit Bezug auf die Tabelle am Ende des Prospektes eine Präzisierung vorgenommen.

Die Bestimmungen von § 17 Ziff. 1 und erster Abschnitt von Ziff. 2 des geänderten Fondsvertrages lauten neu wie folgt:

- "1. Zeichnungs- und Rücknahmeanträge für Anteile werden an jedem Bankwerktag (Auftragstag) bis zu einem bestimmten in der Tabelle am Ende des Prospektes genannten Zeitpunkt von der Depotbank entgegengenommen. Der für die Ausgabe und Rücknahme massgebende Preis der Anteile wird frühestens an dem auf den Auftragstag folgenden Bankwerktag (Bewertungstag) ermittelt (Forward Pricing). In der Tabelle am Ende des Prospektes sind die Einzelheiten geregelt.*
- 2. Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gemäss § 16 berechneten Nettoinventarwert je Anteil."*

\* \* \*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis 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 dieser Mitteilung von den Ziff. 1, Ziff. 3 und Ziff. 4 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

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

Zürich, 13. Juni 2023

### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich