

# AKB OBLIGATIONEN WELT HEDGED CHF ESG FOKUS

Jahresbericht per 30.11.2023

Teilvermögen des AKB Portfoliofonds  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
Q	122341452	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 22.03.2024

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 22. März 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

AKB Portfoliofonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ AKB Einkommen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Rendite CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Rendite EUR ESG Fokus
- ▶ AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Wachstum CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus
- ▶ AKB Obligationen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus<sup>1</sup>

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. November 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr<sup>1</sup>, 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 beigelegten 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.

---

<sup>1</sup> Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 19. Juni 2023 bis 30. November 2023 für das Teilvermögen AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

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. November 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 I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	14
11	Fussnoten	15
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
13	Pflichtpublikationen	18

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

Anlageentscheide Aargauische Kantonalbank, Postfach, 5001 Aarau  
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

Aargauische Kantonalbank, Postfach, 5001 Aarau

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	Lancierung 19.06.2023
	bis	30.11.2023
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		425'086'608.48
<b>Klasse Q</b>	<b>CHF</b>	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		425'086'608.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'287'453.744
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.15
Thesaurierung je Anteil		0.87
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.25 %

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

#### Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse Q (Lancierung 19.06.2023)	-0.85 %	-	-	-

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)	30.11.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'473'637.29
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	381'877'710.86
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	30'590'144.38
Derivative Finanzinstrumente	9'192'299.70
Sonstige Vermögenswerte	2'879'367.65
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>426'013'159.88</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-840'205.80
Andere Verbindlichkeiten	-86'345.60
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>425'086'608.48</b>

#### Entwicklung der Anzahl Anteile

	von	Lancierung 19.06.2023
Klasse Q	bis	30.11.2023
Ausgegebene Anteile		2'422'112.000
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		1'961'523.948
Zurückgenommene Anteile		-96'182.204
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>4'287'453.744</b>



## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse Q	19.06.2023	49'330'214.70	493'302.147
Klasse Q	19.06.2023	6'566'190.80	65'661.908
Klasse Q	19.06.2023	72'053'720.40	720'537.204
Klasse Q	19.06.2023	10'763'432.80	107'634.328
Klasse Q	19.06.2023	22'692'234.20	226'922.342
Klasse Q	19.06.2023	28'888'459.40	288'884.594
Klasse Q	19.06.2023	5'858'142.50	58'581.425

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	19.06.2023 30.11.2023
Saldo aus dem Anteilverkehr		427'396'993.84
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-2'310'385.36
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>425'086'608.48</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	19.06.2023 30.11.2023
<b>Ertrag</b>		
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'067.45
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'749'949.56
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		76'408.20
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		397'712.44
<b>Total Ertrag</b>		<b>4'225'137.65</b>
<b>Aufwand</b>		
Passivzinsen		-387.82
Reglementarische Vergütungen		-422'091.41
Sonstige Aufwendungen		-0.46
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-47'805.17
<b>Total Aufwand</b>		<b>-470'284.86</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>3'754'852.79</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'927'575.73
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		619'137.31
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>1'446'414.37</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'756'799.73
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-2'310'385.36</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse Q	30.11.2023
Nettoertrag	3'754'852.79
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'754'852.79</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'314'198.48
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'440'654.31
<b>Total</b>	<b>3'754'852.79</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>381'877'710.86</b>	<b>89.64</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>381'877'710.86</b>	<b>89.64</b>	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	0	2'025	0	2'025 AUD	90.37%	1'055'033.19	0.25	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	3'500	0	3'500 AUD	76.95%	1'552'746.57	0.36	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	0	2'000	0	2'000 AUD	82.05%	946'103.91	0.22	a)
AU0000048274	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/34	0	2'000	0	2'000 AUD	75.13%	866'377.86	0.20	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	0	2'040	0	2'040 AUD	78.05%	918'049.66	0.22	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	0	1'450	1'450	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	0	2'520	0	2'520 AUD	80.25%	1'165'894.79	0.27	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	0	1'805	0	1'805 AUD	90.74%	944'325.26	0.22	a)
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	1'000	0	1'000 AUD	100.71%	580'631.37	0.14	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	0	2'265	0	2'265 AUD	84.62%	1'104'985.06	0.26	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	0	1'760	0	1'760 AUD	95.29%	966'983.50	0.23	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	0	1'630	0	1'630 AUD	92.65%	870'673.08	0.20	a)
AU3CB0212942	4.7500 % NIB 4 3/4 02/28/24 MTN	0	2'140	2'140	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0235612	3.1000 % EIB 3.1 08/17/26 MTN	0	2'500	500	2'000 AUD	96.31%	1'110'502.84	0.26	a)
AU3CB0237899	3.3500 % AAPL 3.35 01/10/24 MTN	0	630	630	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0239267	3.2500 % SUNAU 3 1/4 08/24/26 162	0	1'000	0	1'000 AUD	95.30%	549'445.51	0.13	a)
AU3CB0260545	3.1000 % ANZ 3.1 02/08/24 MTN	0	250	250	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0276509	1.0000 % NBNAUS 1 12/03/25 MTN	0	2'300	0	2'300 AUD	92.21%	1'222'828.46	0.29	a)
AU3CB0279057	3.1500 % WENNEX 3.15 03/31/31 MTN	0	1'000	0	1'000 AUD	81.92%	472'308.20	0.11	a)
AU3CB0287639	2.4000 % NIB 2.4 09/22/25 MTN	0	2'000	0	2'000 AUD	96.12%	1'108'346.52	0.26	a)
AU3CB0290229	3.7000 % ASIA 3.7 06/17/25 MTN	0	845	845	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0301240	4.7000 % NZLGF 4.7 08/01/28 MTN	0	1'500	0	1'500 AUD	99.46%	860'128.01	0.20	a)
AU3CB0304350	6.4820 % AIANZ 6.482 11/16/33 MTN	0	1'000	0	1'000 AUD	101.81%	587'002.31	0.14	a)
AU3SG0002082	2.0000 % NSWTC 2 03/08/33	0	2'500	0	2'500 AUD	77.84%	1'121'961.87	0.26	a)
AU3SG0002199	1.7500 % WATC 1 3/4 10/22/31	0	1'000	0	1'000 AUD	80.59%	464'668.84	0.11	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	0	2'763	0	2'763 AUD	102.25%	1'628'912.61	0.38	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	0	225	225	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	0	1'720	0	1'720 AUD	95.83%	950'272.40	0.22	a)
XS1306410249	3.7500 % DBHNGR 3 3/4 10/29/25 EMTN	0	620	620	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
XS1732146185	3.2500 % NAB 3 1/4 12/11/24 EMTN	0	200	200	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
<b>AUD</b>							<b>21'048'181.82</b>	<b>4.94</b>	
CA037833CY47	2.5130 % AAPL 2.513 08/19/24 MPLE	0	170	170	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA06368LEY89	4.7090 % BMO 4.709 12/07/27	0	1'500	0	1'500 CAD	98.69%	949'410.67	0.22	a)
CA06415GAZ33	1.9500 % BNS 1.95 01/10/25	0	1'500	0	1'500 CAD	96.48%	928'115.42	0.22	a)
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	0	1'500	0	1'500 CAD	76.33%	734'249.46	0.17	a)
CA11282ZAS70	5.2920 % BAMREP 5.292 10/28/33	0	1'000	0	1'000 CAD	98.62%	632'469.77	0.15	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	0	2'500	0	2'500 CAD	97.02%	1'555'518.72	0.37	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	0	1'185	0	1'185 CAD	94.28%	716'469.67	0.17	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	0	1'660	0	1'660 CAD	91.21%	970'978.59	0.23	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	0	2'604	604	2'000 CAD	93.47%	1'198'893.23	0.28	a)
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	0	1'320	0	1'320 CAD	93.68%	793'064.24	0.19	a)
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	0	1'500	0	1'500 CAD	86.58%	832'926.74	0.20	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	1'500	0	1'500 CAD	81.17%	780'824.93	0.18	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	0	400	400	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	0	1'500	0	1'500 CAD	117.07%	1'126'182.22	0.26	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	0	1'750	0	1'750 CAD	106.72%	1'197'695.55	0.28	a)
CA13509PHM82	1.7500 % CANHOU 1 3/4 06/15/30	0	1'500	0	1'500 CAD	87.81%	844'767.31	0.20	a)
CA13509PHW64	1.6000 % CANHOU 1.6 12/15/31 101	0	1'500	0	1'500 CAD	84.10%	809'078.79	0.19	a)
CA254687CD65	2.7580 % DIS 2.758 10/07/24 MPLE	0	1'500	500	1'000 CAD	97.94%	628'094.92	0.15	a)
CA31430WPB41	4.4070 % CCDJ 4.407 05/19/27	0	1'000	0	1'000 CAD	97.91%	627'906.86	0.15	a)
CA40427HTM56	1.7820 % HSBC 1.782 05/20/26 DPNT	0	1'000	0	1'000 CAD	93.16%	597'485.78	0.14	a)
CA448814HZ92	5.0000 % QHEL 5 02/15/45 JM	0	1'500	0	1'500 CAD	108.05%	1'039'428.61	0.24	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA64953BBE70	5.2500 % NYLIFE 5 1/4 06/30/26	0	1'500	0	1'500 CAD	100.77%	969'402.44	0.23	a)
CA68333ZAV90	3.7500 % ONT 3 3/4 12/02/53	0	2'000	0	2'000 CAD	91.21%	1'169'927.51	0.27	a)
CA713448DQ80	2.1500 % PEP 2.15 05/06/24	0	580	580	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZDK62	5.0000 % Q 5 12/01/38	0	1'250	0	1'250 CAD	106.44%	853'283.38	0.20	a)
CA87971MCC51	5.7500 % TCN 5 3/4 09/08/33	0	1'250	0	1'250 CAD	102.32%	820'303.28	0.19	a)
CA891160LV34	1.9090 % TD 1.909 07/18/23 DPNT	0	590	590	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
<b>CAD</b>							<b>20'776'478.09</b>	<b>4.88</b>	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	0	1'500	0	1'500 EUR	93.96%	1'337'185.37	0.31	a)
AT0000A37249	4.8750 % WIEAV 4 7/8 10/04/28	0	1'000	0	1'000 EUR	102.35%	971'048.57	0.23	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	0	1'500	0	1'500 EUR	85.76%	1'220'487.63	0.29	a)
BE0002767482	0.1250 % GBLBBB 0 1/8 01/28/31	0	1'500	0	1'500 EUR	77.82%	1'107'433.13	0.26	a)
DE0001053551	0.0100 % BAYERN 0.01 05/07/27	0	2'000	0	2'000 EUR	90.57%	1'718'492.88	0.40	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	0	5'000	0	5'000 EUR	74.51%	3'534'518.51	0.83	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	0	3'395	395	3'000 EUR	92.58%	2'635'063.53	0.62	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	2'500	0	2'500 EUR	74.89%	1'776'414.81	0.42	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	0	5'000	2'000	3'000 EUR	94.01%	2'675'680.04	0.63	a)
DE000A13SWG1	1.2500 % PBBGR 1 1/4 04/20/35 EMTN	0	1'067	1'067	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A14KJF5	1.0000 % SAPGR 1 04/01/25 EMTN	0	976	976	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DADM7	0.8500 % MBGGR 0.85 02/28/25 EMTN	0	666	666	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2GSE59	1.1250 % KFW 1 1/8 09/15/32 EMTN	0	1'002	0	1'002 EUR	85.91%	816'740.25	0.19	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	79.79%	757'055.27	0.18	a)
DE000A3KY359	0.5000 % ALVGR 0 1/2 11/22/33	0	2'500	0	2'500 EUR	76.31%	1'809'929.83	0.42	a)
DE000A3LBMV2	3.0000 % MBGGR 3 02/23/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	98.57%	935'232.80	0.22	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	0	3'000	0	3'000 EUR	93.00%	2'647'017.94	0.62	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	0	588	588	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0413860802	1.7500 % SABS M 3/4 05/30/29	0	2'000	0	2'000 EUR	91.45%	1'735'285.97	0.41	a)
EU000A1GODT0	1.2500 % EFSF 1 1/4 05/24/33 EMTN	0	1'245	0	1'245 EUR	85.03%	1'004'393.72	0.24	a)
EU000A1U9928	1.6250 % ESM 1 5/8 11/17/36 EMTN	0	1'530	0	1'530 EUR	82.65%	1'199'694.37	0.28	a)
EU000A283867	0.1000 % EU 0.1 10/04/40 SURE	0	3'000	0	3'000 EUR	58.32%	1'659'811.94	0.39	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	0	2'028	0	2'028 EUR	83.01%	1'597'129.09	0.37	a)
FR0013060209	1.6250 % RTEFRA 1 5/8 11/27/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.40%	914'606.71	0.21	a)
FR0013248507	1.0000 % VIEFP 1 04/03/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.47%	915'223.41	0.21	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	0	3'000	0	3'000 EUR	94.23%	2'682'055.72	0.63	a)
FR0013257623	0.7500 % MCFP 0 3/4 05/26/24 EMTN	0	666	666	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	0	3'000	0	3'000 EUR	65.91%	1'875'987.40	0.44	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	0	3'000	0	3'000 EUR	88.73%	2'525'509.97	0.59	a)
FR0013463668	0.3750 % EFPF 0 3/8 11/27/27 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013486701	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 02/24/26	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013494168	0.2500 % SUFP 0 1/4 03/11/29 EMTN	0	900	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014004GE5	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 07/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	88.28%	837'605.18	0.20	a)
FR001400F711	3.3750 % SUFP 3 3/8 04/13/34 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	99.08%	940'062.00	0.22	a)
FR001400KHW7	3.6250 % KERFP 3 5/8 09/05/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	100.12%	949'938.62	0.22	a)
FR001400KY44	4.1250 % BNP 4 1/8 09/26/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.55%	963'486.94	0.23	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	0	2'500	0	2'500 EUR	90.70%	2'151'318.18	0.50	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	0	2'500	0	2'500 EUR	83.72%	1'985'735.46	0.47	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	0	2'500	0	2'500 EUR	96.89%	2'298'067.96	0.54	a)
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	0	2'500	0	2'500 EUR	91.62%	2'173'234.58	0.51	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	0	2'500	0	2'500 EUR	97.88%	2'321'620.98	0.54	a)
XS1111559925	2.1250 % TTEFP 2 1/8 09/18/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	93.00%	882'301.36	0.21	a)
XS1190624038	1.2500 % EQNR 1 1/4 02/17/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	93.26%	1'769'650.14	0.42	a)
XS1195056079	0.8750 % ROSW 0 7/8 02/25/25 EMTN	0	730	730	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1218809389	0.5000 % IBRD 0 1/2 04/16/30 GDIF	0	820	820	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1218821756	1.0000 % ABNAV 1 04/16/25 EMTN	0	666	666	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1382784509	1.2500 % RABOBK 1 1/4 03/23/26 GMTN	0	996	996	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1402921412	1.5000 % JPM 1 1/2 10/29/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	94.49%	896'494.84	0.21	a)
XS1412417617	1.2500 % NAB 1 1/4 05/18/26 GMTN	0	996	996	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1419646317	1.5000 % BNP 1 1/2 05/25/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1503043694	0.2500 % EIB 0 1/4 09/14/29 EMTN	0	1'357	1'357	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1612977717	1.1250 % EIB 1 1/8 04/13/33 EARN	0	1'200	0	1'200 EUR	84.53%	962'340.83	0.23	a)
XS1615079974	1.6380 % JPM 1.638 05/18/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	92.75%	880'014.84	0.21	a)
XS1615677280	0.6250 % RENTEN 0 5/8 05/18/27 EMTN	0	568	568	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1617831026	1.2500 % BFCM 1 1/4 05/26/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	91.90%	871'893.44	0.20	a)
XS1623404412	0.8500 % USB 0.85 06/07/24 EMTN	0	1'075	1'075	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1648298559	0.8750 % NESNVX 0 7/8 07/18/25 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1788494257	0.8750 % STATNE 0 7/8 03/08/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.34%	914'056.43	0.21	a)
XS1789623029	1.0000 % ENXFP 1 04/18/25	0	1'000	0	1'000 EUR	95.99%	910'745.25	0.21	a)
XS1837288494	1.1250 % KNOGR 1 1/8 06/13/25 EMTN	0	330	330	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877836079	1.0000 % ADM 1 09/12/25	0	2'000	0	2'000 EUR	95.56%	1'813'236.27	0.43	a)
XS1936139770	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 12/18/28 EMTN	0	1'305	1'305	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979280853	0.8750 % VZ 0 7/8 04/08/27	0	1'000	0	1'000 EUR	91.78%	870'783.39	0.20	a)
XS2010032378	0.2500 % ASML 0 1/4 02/25/30	0	1'500	0	1'500 EUR	83.38%	1'186'673.75	0.28	a)
XS2012102914	1.4000 % CB 1.4 06/15/31	0	1'000	0	1'000 EUR	84.56%	802'225.84	0.19	a)
XS2049616621	0.1250 % SIEGR 0 1/8 09/05/29	0	818	818	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	0	1'000	0	1'000 EUR	88.22%	836'950.53	0.20	a)
XS2078409716	0.8750 % CL 0 7/8 11/12/39 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	66.96%	635'291.14	0.15	a)
XS2101336316	0.3750 % ABNAV 0 3/8 01/14/35	0	1'500	0	1'500 EUR	72.44%	1'030'981.88	0.24	a)
XS2102380776	0.7500 % DBHNGR 0 3/4 07/16/35 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	73.06%	1'039'762.67	0.24	a)
XS2118213888	0.6250 % ANVAU 0 5/8 08/25/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	81.02%	768'649.14	0.18	a)
XS2118276026	0.2500 % SIEGR 0 1/4 02/20/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	86.25%	818'278.89	0.19	a)
XS2239067379	0.7500 % AVINOR 0 3/4 10/01/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	82.72%	784'835.03	0.18	a)
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	68.36%	972'860.71	0.23	a)
XS2298304499	0.2000 % SANTAN 0.2 02/11/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	86.49%	820'574.90	0.19	a)
XS2305026762	0.0100 % NTT 0.01 03/03/25 REGS	0	1'020	0	1'020 EUR	95.32%	922'466.64	0.22	a)
XS2326546350	0.5000 % UBS 0 1/2 03/31/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	78.59%	745'670.12	0.18	a)
XS2338561348	0.5000 % NWDIE 0 1/2 05/05/41 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	60.86%	1'154'795.34	0.27	a)
XS2339399359	0.9500 % KO 0.95 05/06/36	0	1'500	0	1'500 EUR	74.13%	1'055'018.77	0.25	a)
XS2355599353	0.0100 % KHFC 0.01 06/29/26 REGS	0	2'500	0	2'500 EUR	91.08%	2'160'212.82	0.51	a)
XS2385121582	0.7730 % EJRAIL 0.773 09/15/34 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	74.18%	1'055'644.95	0.25	a)
XS2418730995	0.1250 % INTNED 0 1/8 12/08/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	78.49%	744'692.90	0.17	a)
XS2432293673	0.2500 % ENELIM 0 1/4 11/17/25	0	2'000	0	2'000 EUR	93.68%	1'777'638.71	0.42	a)
XS2446841657	0.3750 % EIB 0 3/8 09/15/27 EARN	0	2'000	0	2'000 EUR	91.14%	1'729'479.55	0.41	a)
XS2456884746	0.3870 % UOBSP 0.387 03/17/25 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	95.79%	2'271'953.28	0.53	a)
XS2535307743	2.6250 % MDT 2 5/8 10/15/25	0	1'000	0	1'000 EUR	97.96%	929'397.91	0.22	a)
XS2547591474	3.6020 % SUMIBK 3.602 02/16/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	99.61%	945'071.47	0.22	a)
XS2551903425	4.1250 % HON 4 1/8 11/02/34	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2558395351	3.6250 % ENBW 3 5/8 11/22/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	100.50%	953'458.52	0.22	a)
XS2573331324	3.6250 % ABNAV 3 5/8 01/10/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575556589	3.3750 % ABBNVX 3 3/8 01/16/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	99.26%	941'769.77	0.22	a)
XS2577054716	4.0000 % LFBANK 4 01/18/27 EMTN	0	1'300	300	1'000 EUR	100.22%	950'877.98	0.22	a)
XS2590621103	4.1250 % NBNAUS 4 1/8 03/15/29 GMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.25%	960'574.24	0.23	a)
XS2610788569	3.8750 % CARGIL 3 7/8 04/24/30	0	1'000	0	1'000 EUR	100.92%	957'452.81	0.22	a)
XS2614623978	4.2250 % TCLAU 4.225 04/26/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.19%	960'052.42	0.23	a)
XS2655865546	3.8500 % TOYOTA 3.85 07/24/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.19%	960'014.47	0.23	a)
XS2656481004	3.5000 % RY 3 1/2 07/25/28	0	1'000	0	1'000 EUR	100.55%	953'999.32	0.22	a)
XS2673140633	3.7680 % CBAAU 3.768 08/31/27	0	2'500	0	2'500 EUR	101.12%	2'398'399.56	0.56	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	102.28%	970'365.46	0.23	a)
XS2679903950	4.1250 % LSELN 4 1/8 09/29/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.41%	962'168.16	0.23	a)
XS2712746960	3.9130 % RABOBK 3.913 11/03/26 GMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	100.85%	956'817.14	0.22	a)
<b>EUR</b>							<b>103'559'662.34</b>	<b>24.31</b>	
FR001400F794	5.0000 % BFCM 5 01/19/26 EMTN	0	800	300	500 GBP	98.95%	544'618.67	0.13	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	0	500	0	500 GBP	102.59%	564'647.85	0.13	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	0	1'492	0	1'492 GBP	101.21%	1'662'276.86	0.39	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	0	1'000	0	1'000 GBP	99.16%	1'091'560.04	0.26	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	0	1'041	0	1'041 GBP	100.47%	1'151'325.82	0.27	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	0	1'360	0	1'360 GBP	101.99%	1'526'889.51	0.36	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	0	1'000	0	1'000 GBP	51.98%	572'199.39	0.13	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	0	3'000	0	3'000 GBP	54.93%	1'814'019.56	0.43	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	0	1'395	395	1'000 GBP	89.46%	984'781.78	0.23	a)
GB00BHBFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	0	100	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	0	3'000	0	3'000 GBP	59.57%	1'967'251.87	0.46	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	0	1'642	0	1'642 GBP	78.20%	1'413'484.39	0.33	a)
GB00BMR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	1'500	0	1'500 GBP	75.06%	1'239'398.40	0.29	a)
GB00BMR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	0	3'000	0	3'000 GBP	66.41%	2'193'137.43	0.51	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	0	3'000	0	3'000 GBP	72.39%	2'390'622.17	0.56	a)
XS0095130943	4.8750 % IBRD 4 7/8 12/07/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	101.69%	1'679'115.68	0.39	a)
XS0765619407	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 03/30/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	99.89%	1'099'562.91	0.26	a)
XS0834641358	3.5000 % MET 3 1/2 09/30/26 GMTN	0	368	368	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0860561942	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/30/23 EMTN	0	615	615	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0866588527	3.3750 % GSK 3 3/8 12/20/27 EMTN	0	150	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1490724975	1.0000 % EIB 1 09/21/26 EMTN	0	1'150	0	1'150 GBP	90.51%	1'145'727.99	0.27	a)
XS1608101652	1.8000 % PG 1.8 05/03/29	0	580	0	580 GBP	87.60%	559'272.39	0.13	a)
XS1640854144	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/07/25 EMTN	0	635	635	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1681522568	1.2500 % TTEFP 1 1/4 12/16/24 EMTN	0	855	855	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1684780205	1.8750 % UNANA 1 7/8 09/15/29 EMTN	0	810	310	500 GBP	86.08%	473'776.25	0.11	a)
XS2035406987	0.8750 % RENTEN 0 7/8 12/15/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	89.45%	984'704.72	0.23	a)
XS2354308194	1.3750 % NESNVX 1 3/8 06/23/33 EMTN	0	500	0	500 GBP	73.78%	406'087.64	0.10	a)
XS2434385436	1.1250 % KUNTA 1 1/8 06/19/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	93.95%	1'034'197.00	0.24	a)
XS2491214792	2.5000 % IADB 2 1/2 07/22/27	0	1'500	0	1'500 GBP	93.10%	1'537'243.70	0.36	a)
XS2586741543	4.6250 % DANBNK 4 5/8 04/13/27 EMTN	0	800	300	500 GBP	97.41%	536'125.95	0.13	a)
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	101.01%	1'111'924.97	0.26	a)
XS2667627124	5.7200 % CAT 5.72 08/17/26 EMTN	0	500	0	500 GBP	101.51%	558'714.50	0.13	a)
XS2669894821	6.1250 % NWIDE 6 1/8 08/21/28 EMTN	0	500	0	500 GBP	103.28%	568'434.63	0.13	a)
<b>GBP</b>							<b>30'811'102.07</b>	<b>7.23</b>	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	0	167'000	0	167'000 JPY	104.20%	1'023'554.33	0.24	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	0	184'000	0	184'000 JPY	123.00%	1'331'174.56	0.31	a)
XS0171578502	1.0500 % DBJP 1.05 06/20/23 INTL	0	84'000	84'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0233761138	2.4000 % C 2.4 10/31/25 INTL	0	250'000	0	250'000 JPY	102.65%	1'509'496.66	0.35	a)
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	0	100'300	0	100'300 JPY	103.87%	612'762.53	0.14	a)
XS0257403278	2.3000 % DBJP 2.3 03/19/26 INTL	0	130'000	0	130'000 JPY	104.63%	800'019.65	0.19	a)
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	0	167'500	0	167'500 JPY	106.15%	1'045'778.07	0.25	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	0	410'000	0	410'000 JPY	107.59%	2'594'548.44	0.61	a)
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	0	100'000	0	100'000 JPY	99.61%	585'878.41	0.14	a)
<b>JPY</b>							<b>9'503'212.65</b>	<b>2.23</b>	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	0	17'920	17'920	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	0	17'225	17'225	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	0	20'980	20'980	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	0	19'450	19'450	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	0	22'940	22'940	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	0	18'630	18'630	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	0	18'700	18'700	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	0	25'330	25'330	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
XS1185971923	1.5000 % NIB 1 1/2 03/13/25 EMTN	0	7'610	7'610	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
XS1555330999	1.5000 % EIB 1 1/2 01/26/24 EMTN	0	13'780	13'780	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
XS1805263743	1.8750 % NIB 1 7/8 04/10/24 EMTN	0	12'740	12'740	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
<b>NOK</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	0	6'260	6'260	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	0	13'570	13'570	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	0	5'760	5'760	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	0	19'310	19'310	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	0	10'750	10'750	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0010442731	1.2500 % NDASS 1 1/4 09/20/23 #5533 5533	0	6'100	6'100	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	0	7'540	7'540	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0012142206	1.0000 % SWEDA 1 09/18/24 #194 194	0	10'000	10'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	0	15'110	15'110	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
XS1171476143	1.2500 % EIB 1 1/4 05/12/25 EMTN	0	7'730	7'730	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
<b>SEK</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
US00724PAD15	2.3000 % ADBE 2.3 02/01/30	0	1'260	0	1'260 USD	86.90%	952'070.10	0.22	a)
US013051EH65	1.8750 % ALTA 1 7/8 11/13/24	0	2'500	0	2'500 USD	96.80%	2'104'415.00	0.49	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US02079KAC18	1.9980 % GOOGL 1.998 08/15/26	0	1'250	0	1'250 USD	93.30%	1'014'124.98	0.24	a)
US02079KAE73	1.9000 % GOOGL 1.9 08/15/40	0	3'000	0	3'000 USD	65.93%	1'719'894.66	0.40	a)
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	1'570	0	1'570 USD	94.77%	1'293'781.24	0.30	a)
US03040WAW55	2.8000 % AWK 2.8 05/01/30	0	2'000	0	2'000 USD	86.58%	1'505'676.02	0.35	a)
US032095AM37	4.7500 % APH 4 3/4 03/30/26	0	1'000	0	1'000 USD	99.11%	861'805.15	0.20	a)
US037833BY53	3.2500 % AAPL 3 1/4 02/23/26	0	1'180	0	1'180 USD	96.80%	993'276.00	0.23	a)
US037833CG39	3.0000 % AAPL 3 02/09/24	0	380	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05578BAT35	1.0000 % BPCEGP 1 01/20/26 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05578BHP40	4.7500 % BPCEGP 4 3/4 07/19/27 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	96.81%	1'262'730.08	0.30	a)
US06051GJS93	1.7340 % BAC 1.734 07/22/27	0	2'000	0	2'000 USD	90.29%	1'570'313.02	0.37	a)
US06367WHH97	3.3000 % BMO 3.3 02/05/24 E	0	380	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126408HW63	5.2000 % CSX 5.2 11/15/33	0	1'000	0	1'000 USD	99.58%	865'892.13	0.20	a)
US14913UAB61	5.1500 % CAT 5.15 08/11/25	0	1'500	0	1'500 USD	100.08%	1'305'388.70	0.31	a)
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	0	2'000	0	2'000 USD	71.67%	1'246'352.99	0.29	a)
US191216CU25	1.4500 % KO 1.45 06/01/27	0	1'060	0	1'060 USD	89.78%	827'494.94	0.19	a)
US20030NDM02	1.9500 % CMCSA 1.95 01/15/31	0	2'500	0	2'500 USD	81.43%	1'770'087.74	0.42	a)
US22535EAE77	5.5890 % ACAFP 5.589 07/05/26 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	100.42%	1'746'352.05	0.41	a)
US22550LZE08	0.4950 % CS 0.495 02/02/24	0	1'110	1'110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EXB00	4.9500 % DE 4.95 07/14/28 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	100.23%	1'743'064.23	0.41	a)
US25468PDF09	3.1500 % DIS 3.15 09/17/25 GMTN	0	1'270	270	1'000 USD	96.77%	841'462.67	0.20	a)
US29736RAM25	3.1250 % EL 3 1/8 12/01/49	0	2'000	0	2'000 USD	67.25%	1'169'583.11	0.27	a)
US370334CS18	5.2410 % GIS 5.241 11/18/25	0	1'000	0	1'000 USD	99.78%	867'661.12	0.20	a)
US38145GAH39	3.5000 % GS 3 1/2 11/16/26	0	2'000	0	2'000 USD	95.41%	1'659'348.54	0.39	a)
US404280DZ92	5.8870 % HSBC 5.887 08/14/27	0	1'000	0	1'000 USD	100.18%	871'135.29	0.20	a)
US437076BC57	3.7500 % HD 3 3/4 02/15/24	0	1'440	1'440	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US440452AF79	1.8000 % HRL 1.8 06/11/30	0	1'345	0	1'345 USD	82.40%	963'748.90	0.23	a)
US458140BQ26	3.7500 % INTC 3 3/4 03/25/27	0	1'095	0	1'095 USD	96.60%	919'769.74	0.22	a)
US46625HRV41	2.9500 % JPM 2.95 10/01/26	0	2'300	0	2'300 USD	94.53%	1'890'655.17	0.44	a)
US471048CJ53	0.6250 % JBC 0 5/8 07/15/25	0	2'500	0	2'500 USD	93.00%	2'021'618.19	0.47	a)
US478160CQ51	1.3000 % JNJ 1.3 09/01/30	0	2'500	0	2'500 USD	81.46%	1'770'831.08	0.42	a)
US57636QAS30	1.9000 % MA 1.9 03/15/31	0	1'150	0	1'150 USD	82.36%	823'618.46	0.19	a)
US58933YAR62	2.7500 % MRK 2 3/4 02/10/25	0	2'500	1'000	1'500 USD	97.28%	1'268'865.49	0.30	a)
US594918BJ27	3.1250 % MSFT 3 1/8 11/03/25	0	1'875	875	1'000 USD	96.94%	842'929.73	0.20	a)
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	0	2'500	0	2'500 USD	96.22%	2'091'686.00	0.49	a)
US606822CH58	4.7880 % MUFG 4.788 07/18/25	0	1'000	0	1'000 USD	99.28%	863'280.54	0.20	a)
US60687YCY07	5.7780 % MIZUHO 5.778 07/06/29	0	2'000	0	2'000 USD	101.12%	1'758'629.73	0.41	a)
US60871RAG56	3.0000 % TAP 3 07/15/26	0	1'000	0	1'000 USD	94.75%	823'885.89	0.19	a)
US61761J3R84	3.1250 % MS 3 1/8 07/27/26 MTN	0	1'000	0	1'000 USD	94.53%	821'997.24	0.19	a)
US62878VZF69	5.7500 % NBNAUS 5 3/4 10/06/28 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	102.61%	1'338'393.97	0.31	a)
US63111XAJ00	5.5500 % NDAQ 5.55 02/15/34	0	1'000	0	1'000 USD	99.99%	869'480.26	0.20	a)
US654106AK94	2.8500 % NKE 2.85 03/27/30	0	2'100	0	2'100 USD	89.59%	1'635'917.02	0.38	a)
US66989HAG39	3.4000 % NOVNVX 3.4 05/06/24	0	1'394	1'394	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US66989HAH12	4.4000 % NOVNVX 4.4 05/06/44	0	1'500	0	1'500 USD	90.13%	1'175'620.65	0.28	a)
US68233JCK88	4.5500 % ONCRX 4.55 09/15/32	0	1'000	0	1'000 USD	94.51%	821'786.31	0.19	a)
US68389BXM65	2.6500 % ORCL 2.65 07/15/26	0	1'150	0	1'150 USD	93.69%	936'871.52	0.22	a)
US713448CM83	3.6000 % PEP 3.6 03/01/24	0	1'100	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448ES36	2.7500 % PEP 2 3/4 03/19/30	0	1'000	0	1'000 USD	89.33%	776'752.04	0.18	a)
US716973AA02	4.6500 % PFE 4.65 05/19/25	0	1'500	0	1'500 USD	99.34%	1'295'677.92	0.30	a)
US731011AW25	5.5000 % POLAND 5 1/2 04/04/53	0	1'000	0	1'000 USD	96.50%	839'111.17	0.20	a)
US74456QCM69	5.1250 % PEG 5 1/8 03/15/53 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	95.52%	1'661'240.49	0.39	a)
US78016EZM29	0.8750 % RY 0 7/8 01/20/26 GMTN	0	1'250	0	1'250 USD	91.23%	991'662.72	0.23	a)
US792860AK49	6.7500 % TRV 6 3/4 06/20/36	0	1'000	0	1'000 USD	112.03%	974'188.12	0.23	a)
US87612EBE59	2.5000 % TGT 2 1/2 04/15/26	0	1'280	1'280	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612EBM75	1.9500 % TGT 1.95 01/15/27	0	1'500	0	1'500 USD	91.98%	1'199'766.83	0.28	a)
US87973RAV24	2.2500 % TEMASE 2 1/4 04/06/51 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	62.70%	1'090'363.53	0.26	a)
US88032XAG97	3.5950 % TENCNT 3.595 01/19/28 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	93.60%	813'873.98	0.19	a)
US883556CZ38	5.0000 % TMO 5 12/05/26	0	1'000	0	1'000 USD	100.30%	872'156.50	0.20	a)
US89115A2U52	5.5230 % TD 5.523 07/17/28 MTN	0	1'500	0	1'500 USD	100.84%	1'315'219.11	0.31	a)
US904764BH90	2.1250 % UNANA 2 1/8 09/06/29	0	1'500	0	1'500 USD	86.74%	1'131'322.71	0.27	a)
US911312BL96	2.8000 % UPS 2.8 11/15/24	0	380	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	0	5'000	0	5'000 USD	101.55%	4'415'004.48	1.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	0	5'000	0	5'000 USD	88.45%	3'845'720.52	0.90	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	0	5'000	0	5'000 USD	75.23%	3'271'002.76	0.77	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	0	5'000	0	5'000 USD	76.36%	3'319'914.94	0.78	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	0	5'000	0	5'000 USD	85.55%	3'719'364.48	0.87	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	0	5'000	0	5'000 USD	65.58%	2'851'172.71	0.67	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	0	5'000	0	5'000 USD	75.36%	3'276'437.44	0.77	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	0	5'000	0	5'000 USD	50.80%	2'208'521.35	0.52	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	0	5'000	0	5'000 USD	59.23%	2'575'362.76	0.60	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	0	5'000	0	5'000 USD	70.69%	3'073'315.78	0.72	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	0	10'000	0	10'000 USD	63.69%	5'537'946.56	1.30	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	0	5'000	0	5'000 USD	92.38%	4'016'234.06	0.94	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	0	10'000	0	10'000 USD	92.70%	8'060'999.80	1.89	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	0	10'000	0	10'000 USD	93.78%	8'154'748.59	1.91	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	0	1'372	1'372	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	0	5'000	0	5'000 USD	93.75%	4'076'015.63	0.96	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	0	10'000	0	10'000 USD	93.23%	8'107'195.51	1.90	a)
US912828T917	1.6250 % T 1 5/8 10/31/23	0	3'875	3'875	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	0	5'000	0	5'000 USD	93.23%	4'053'597.76	0.95	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	0	5'000	0	5'000 USD	93.50%	4'065'146.25	0.95	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	0	10'000	2'500	7'500 USD	96.05%	6'263'817.34	1.47	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	0	5'000	0	5'000 USD	86.61%	3'765'559.32	0.88	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	0	5'000	0	5'000 USD	86.83%	3'775'069.59	0.89	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	0	10'000	0	10'000 USD	79.47%	6'910'205.16	1.62	a)
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	0	10'000	0	10'000 USD	86.97%	7'562'367.66	1.78	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	0	5'000	0	5'000 USD	80.16%	3'484'993.36	0.82	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	0	5'000	0	5'000 USD	82.98%	3'607'953.38	0.85	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	5'000	0	5'000 USD	93.48%	4'064'467.13	0.95	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	0	2'000	0	2'000 USD	68.09%	1'184'182.93	0.28	a)
US92826CAD48	3.1500 % V 3.15 12/14/25	0	2'000	0	2'000 USD	96.61%	1'680'094.98	0.39	a)
US931142DP52	3.3000 % WMT 3.3 04/22/24	0	1'270	1'270	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142EX77	3.9500 % WMT 3.95 09/09/27	0	1'000	0	1'000 USD	98.13%	853'299.78	0.20	a)
US961214CX95	2.8500 % WSTP 2.85 05/13/26	0	1'005	1'005	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USQ97417FA49	1.5520 % WSTP 1.552 09/30/26 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	91.07%	791'916.58	0.19	a)
USU64106CA08	4.9500 % NESNVX 4.95 03/14/30 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	101.05%	1'318'072.59	0.31	a)
USU75000BW55	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	87.01%	1'134'945.36	0.27	a)
XS1185955306	2.3750 % JFM 2 3/8 02/13/25 REGS	0	2'500	0	2'500 USD	96.47%	2'097'050.26	0.49	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	0	2'000	0	2'000 USD	77.47%	1'347'310.82	0.32	a)
XS2624016932	3.5000 % BNG 3 1/2 05/19/28 REGS	0	2'500	0	2'500 USD	95.90%	2'084'746.13	0.49	a)
XS2651619285	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 USD	95.74%	832'489.37	0.20	a)
<b>USD</b>							<b>196'179'073.89</b>	<b>46.05</b>	

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

**30'590'144.38 7.18**

#### Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

**30'590'144.38 7.18**

IE0033005699	VANGUARD JAP GV BD IDX INST	0	340'000	0	340'000 JPY	15'296.25	30'590'144.38	7.18	a)
--------------	-----------------------------	---	---------	---	-------------	-----------	---------------	------	----

**JPY 30'590'144.38 7.18**

#### Derivative Finanzinstrumente

**9'192'299.70 2.16**

#### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 08.08.2023	71'016'179	79'650'000		CHF/USD		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 08.08.2023	9'368'247	1'479'450'000		CHF/JPY		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.08.2023	42'211'847	43'230'000		CHF/EUR		0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 08.08.2023	20'403'430	17'870'000		CHF/GBP		0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 08.08.2023	10'714'699	15'860'000		CHF/CAD		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 08.08.2023	12'443'801	1'970'000'000		CHF/JPY		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 08.08.2023	8'128'044	8'310'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 08.08.2023	16'650'835	18'700'000		CHF/USD		0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 08.08.2023	14'133'094	23'120'000		CHF/AUD		0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 19.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 08.08.2023		4'659'346	7'800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.08.2023		2'734'098	4'050'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2023		16'459'823	16'880'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		41'629'656	46'475'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		17'473'170	20'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2023		14'996'829	15'710'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.08.2023		15'014'770	2'440'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.08.2023		7'983'278	12'100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		57'929'790	65'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.08.2023		2'999'859	5'200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.08.2023		6'492'796	1'057'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2023		24'469'293	25'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.08.2023		11'504'513	10'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.11.2023		200'693'934	230'895'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.11.2023		20'654'752	36'120'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.11.2023		31'098'441	28'170'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.11.2023		104'621'523	109'530'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.11.2023		20'837'550	32'010'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.11.2023		42'939'369	6'947'050'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.11.2023		9'090'000	8'291'144		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2023		198'563'607	221'805'000		CHF/USD	5'847'550.94	1.37	b)
	EUR/CHF Verfall 08.12.2023		105'430'511	109'530'000		CHF/EUR	1'563'072.40	0.37	b)
	GBP/CHF Verfall 08.12.2023		31'242'896	28'170'000		CHF/GBP	256'943.80	0.06	b)
	JPY/CHF Verfall 08.12.2023		41'715'437	6'947'050'000		CHF/JPY	837'143.57	0.20	b)
	AUD/CHF Verfall 08.12.2023		21'031'303	36'120'000		CHF/AUD	217'908.47	0.05	b)
	CAD/CHF Verfall 08.12.2023		20'984'700	32'010'000		CHF/CAD	469'680.52	0.11	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>9'192'299.70</b>	<b>2.16</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'473'637.29	0.35
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	381'877'710.86	89.64
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	30'590'144.38	7.18
Derivative Finanzinstrumente	9'192'299.70	2.16
Sonstige Vermögenswerte	2'879'367.65	0.68
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>426'013'159.88</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-840'205.80	
Andere Verbindlichkeiten	-86'345.60	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>425'086'608.48</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);	412'467'855.24	96.82
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	9'192'299.70	2.16
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	
AUD	1 = CHF 0.57655513
CAD	1 = CHF 0.64133201
EUR	1 = CHF 0.94876215
GBP	1 = CHF 1.10080682
JPY	100 = CHF 0.58819000
USD	1 = CHF 0.86955000



## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	410'014'246.49	96.454

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

Periode: 19.06.2023 - 30.11.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
Q	CHF	0.25	-	0.15	-

## 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:** 19.06.2023 - 30.11.2023

Klasse	PVK p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Max
Q	0.25	1.000	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

Dieser Fonds 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 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

**Ex-Datum:** 19.03.2024

**Thesaurierung an Anteilscheininhaber**

**Zahlbar:** 22.03.2024

Klasse	Affidavit- fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
Q	Ja	CHF	0.87577	0.30651	0.56926

## 11 Fussnoten

- 1) Der 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.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens wird zum Verkehrswert und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) 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 der Teilvermögen 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 Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens 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 solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern 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 für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn 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.

8.

- a) Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die weder kotiert sind noch an einem geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, werden anfänglich zu ihrem Erwerbswert bewertet und anschliessend regelmässig (soweit möglich mindestens einmal pro Quartal) von der Fondsleitung neu geschätzt, wobei sich die Fondsleitung auf das Urteil qualifizierter, unabhängiger und im massgeblichen Bereich erfahrener Experten stützt. Die Bewertung erfolgt auf Grundlage des tatsächlichen Verkehrswerts dieser Effekten, also des Preises, zu dem die Effekten kurzfristig wahrscheinlich verkauft werden könnten, und nicht des langfristig möglicherweise erzielbaren Preises.

Die Fondsleitung nimmt eine Zwischenschätzung vor, sofern sich in einer dieser Gesellschaften eine bedeutende Veränderung mit unmittelbarer Auswirkung auf den Wert der gehaltenen Beteiligungen ergibt.

- b) Die Effekten von Gesellschaften, die ihr IPO lanciert haben und deren Titel Verkaufsrestriktionen unterliegen, gelten zu Bewertungszwecken als nicht kotierte oder an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte Effekten. Sofern der Börsenwert dieser Effekten das Doppelte des letzten gemäss lit. a oben geschätzten Wertes erreicht, ist die Fondsleitung ermächtigt, eine Bewertungsmethode anzuwenden, die eine degressive Unterbewertung von bis zu 50% des Börsenkurses vorsieht, welche an jedem Bankwerktag linear vermindert wird, bis zu dem Tag, an dem die betreffenden Effekten auf dem Markt frei verkauft werden können.
- c) Die Anleger können bei der Fondsleitung nähere Angaben zur Bewertung solcher Anlagen einholen.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### AKB Portfoliofonds

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

(nachstehend «der Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

Betreffend die geplante Fondsvertragsänderung erfolgte bereits am 1. November 2022 eine Mitteilung auf der Internetplattform [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com).

Unter Ziff. 3.3 dieser Mitteilung wurde unter anderem darauf hingewiesen, dass § 22 Ziff. 3 des geänderten Fondsvertrags dahingehend ergänzt wird, dass Erträge, welche Zielfonds aus direktem Grundbesitz erzielt haben, von der Fondsleitung ausgeschüttet oder zur Wiederanlage zurückbehalten werden können. Diese Ergänzung wird rückgängig gemacht beziehungsweise wieder aus dem Fondsvertrag gelöscht.

\*\*\*

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie gegen die vorliegend umschriebene Anpassung des Fondsvertrags keine Einwendungen erheben können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht des Umbrella-Fonds, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger der jeweiligen Anteilsklasse sowie die Änderungen der Rechtsdokumente im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 2. Dezember 2022

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### AKB Portfoliofonds

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

(nachfolgend «Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, in den nachfolgenden Bestimmungen zu ändern.

Die Dach-/Zielfondsquote wird bei einigen Teilvermögen angepasst. Dies führt zu Anpassungen in der teilfondsspezifischen Anlagepolitik, vgl. Ziff. 1 und 2 dieser Mitteilung.

Die Anpassung bei der Dach-/Zielfondsquoten führt zu Anpassungen unter der Risikoverteilung, vgl. Ziff. 3 dieser Mitteilung.

Weiter werden diverse Anpassungen vorgenommen, vgl. Ziff. 4 dieser Mitteilung.

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

### 1. Anpassung Anlagepolitik betreffend Dach-/Zielfondsquote bei den Dachfonds

Investitionen in Forderungswertpapiere und -wertrechte und in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte können direkt oder indirekt erfolgen.

#### AKB Portfolio Teilvermögen als Dachfonds

Betreffend indirekten Anlagen in Forderungswertpapieren und -wertrechten reduzieren folgende Teilvermögen den Prozentsatz von bisher 35% auf neu 30% den sie als Dachfonds höchstens in das Teilvermögen AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus als Zielfonds investieren können, vgl. § 8 Ziff. 4 lit. a des geänderten Fondsvertrages:

- AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus
- AKB Wachstum CHF ESG Fokus
- AKB Aktien CHF ESG Fokus

Betreffend indirekten Anlagen in Beteiligungswertpapieren und -wertrechten wird das Teilvermögen AKB Aktien USA Top Selection ESG Fokus (Teilvermögen des Umbrella-Fonds AKB Institutional Funds) zusätzlich als

möglicher Zielfonds aufgenommen. Die Teilvermögen können höchstens die nachfolgend genannten Vermögen der Teilvermögen in diesen Zielfonds investieren, vgl. § 8 Ziff. 4 lit. b des geänderten Fondsvertrages:

- AKB Einkommen CHF ESG Fokus höchstens 30%
- AKB Rendite CHF ESG Fokus höchstens 30%
- AKB Rendite EUR ESG Fokus höchstens 30%
- AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus höchstens 30%
- AKB Wachstum CHF ESG Fokus höchstens 35%
- AKB Aktien CHF ESG Fokus höchstens 45%

### **AKB Vorsorge Teilvermögen als Dachfonds**

Betreffend indirekten Anlagen in Forderungswertpapieren und -wertrechten erhöht das Teilvermögen AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus als Dachfonds den Prozentsatz, welches das Teilvermögen in den Zielfonds AKB Obligationen CHF ESG Fokus investieren kann von bisher 30% auf neu 35%, vgl. § 8 Ziff. 5 lit. a des geänderten Fondsvertrages.

Betreffend indirekten Anlagen in Beteiligungswertpapieren und -wertrechten erhöhen folgende Teilvermögen den Prozentsatz, den sie als Dachfonds in den Zielfonds AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus investieren können, vgl. § 8 Ziff. 5 lit. b des geänderten Fondsvertrages:

- AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus von bisher 30% auf neu 35%
- AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus von bisher 40% auf neu 45%

## **2. Anpassung Anlagepolitik betreffend Dach-/Zielfondsquote bei den Zielfonds**

Die unter Ziff. 1 dieser Mitteilung dargelegten Anpassungen werden sodann auch unter den Zielfonds umgesetzt.

### **AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus als Zielfonds**

Die Liste der Dachfonds, welche mehr als 30% des Vermögens in diesen Zielfonds investieren können, wird ergänzt um den Dachfonds AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus mit dem Höchstsatz von 35% und beim Dachfonds AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus beträgt der Höchstsatz neu 45% (bisher 40%), vgl. § 8 Ziff. 6 lit. h.

### **AKB Obligationen CHF ESG Fokus als Zielfonds**

Die Liste der Dachfonds, welche mehr als 30% des Vermögens in diesen Zielfonds investieren können, wird ergänzt um den Dachfonds AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus mit dem Höchstsatz von 35%, vgl. § 8 Ziff. 9 lit. i des geänderten Fondsvertrages.

### **AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus als Zielfonds**

Bei der Liste der Dachfonds, welche mehr als 30% des Vermögens in diesen Zielfonds investieren können, werden die folgenden Dachfonds ersatzlos gestrichen, vgl. § 8 Ziff. 10 lit. j des geänderten Fondsvertrages:

- AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus
- AKB Wachstum CHF ESG Fokus
- AKB Aktien CH ESG Fokus

## **3. Anpassung Risikoverteilung betreffend Dach-/Zielfondsquote**

Unter der Risikoverteilung wird die Anpassung der Dach-/Zielfondsquote analog umgesetzt. Die Übersicht der Dach-/Zielfonds, bei welchen die Dachfonds mehr als 30% des Vermögens des Dachfonds in einen Zielfonds investieren können, sieht neu wie folgt aus, vgl. § 15 Ziff. 8 des geänderten Fondsvertrages:



Dachfonds		Zielfonds
AKB Einkommen CHF ESG Fokus	45%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
	45%	AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus
AKB Rendite CHF ESG Fokus	40%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
	35%	AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus
AKB Rendite EUR ESG Fokus	35%	AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus
AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus	40%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
AKB Wachstum CHF ESG Fokus	35%	AKB Aktien USA Top Selection ESG Fokus*
AKB Aktien CHF ESG Fokus	35%	AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus
	45%	AKB Aktien USA Top Selection ESG Fokus*
AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus	55%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus	45%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
	35%	AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus
AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus	35%	AKB Obligation CHF ESG Fokus
	45%	AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

\*Teilvermögen des Umbrella-Fonds AKB Institutional Funds

#### 4. Diverse Anpassungen

Unter § 12, II. Abschnitt sind die Teilvermögen aufgeführt, welche den Commitment-Ansatz II anwenden. Unter Ziff. 8 sind die weiteren Angaben aufgeführt, welcher der Prospekt enthält. Die Liste wurde um die Sicherheitenstrategie erweitert.

Unter § 24 Ziff. 2 sind die Kriterien aufgeführt, die erfüllt sein müssen, dass Teilvermögen bzw. Anlagefonds vereinigt werden können. Unter lit. d und e wird die Bestimmung nebst Teilvermögen auch um Anlagefonds ergänzt.

\*\*\*

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 umschriebenen Änderungen der Ziffern 1 bis 3 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 der Rechtsdokumente im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. Februar 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### AKB Portfoliofonds

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»  
(nachfolgend «Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

Betreffend die geplante Fondsvertragsänderung erfolgte bereits am 24. Februar 2023 eine Mitteilung auf der Internetplattform [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com).

Unter Ziff. 1 dieser Mitteilung wurde unter dem Abschnitt AKB Portfolio Teilvermögen unter anderem betreffend indirekten Anlagen in Beteiligungswertpapieren und -wertrechten darauf hingewiesen, dass das Teilvermögen AKB Aktien USA Top Selection ESG Fokus (Teilvermögen des Umbrella-Fonds AKB Institutional Funds) zusätzlich als möglicher Zielfonds aufgenommen wird. Mit Verweis auf § 8 Ziff. 4 lit. b des geänderten Fondsvertrages wurde betreffend dem Teilvermögen AKB Einkommen CHF ESG Fokus darauf hingewiesen, dass dieses Teilvermögen höchstens 30% des Vermögens in diesen Zielfonds investieren kann.

Da das Teilvermögen AKB Einkommen CHF ESG Fokus insgesamt höchstens 20% des Vermögens in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte investieren darf, beträgt die Limite, wie viel es höchstens in den möglichen Zielfonds AKB Aktien USA Top Selection ESG Fokus investieren kann ebenfalls 20%.

\*\*\*

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie gegen die vorliegend umschriebene Anpassung des Fondsvertrags keine Einwendungen erheben können.

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

Zürich, 30. März 2023

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### AKB Portfoliofonds

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

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(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.

Die teilfondsspezifische Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie Ziff. 7 bis Ziff. 10 des Fondsvertrages präzisiert werden.

In den erwähnten Bestimmungen werden bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente unter Forderungswertpapieren und -wertrechten neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

In der angepassten Bestimmung der Teilvermögen AKB Einkommen CHF ESG Fokus, AKB Rendite CHF ESG Fokus, AKB Rendite EUR ESG Fokus, AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus, AKB Wachstum CHF ESG Fokus, AKB Aktien CHF ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 4 lit. a des angepassten Fondsvertrages.

In der angepassten Bestimmung der Teilvermögen AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus, AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus und AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 5 lit. a des angepassten Fondsvertrages.

In der angepassten Bestimmung des Teilvermögens AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Schuldverschreibungen, Pfandbriefe u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 7 lit. bd.

In der angepassten Bestimmung des Teilvermögens AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Schuldverschreibungen, Pfandbriefe u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 8 lit. bb.

In der angepassten Bestimmung des Teilvermögens AKB Obligationen CHF ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Bail-in Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 9 lit. a.

In der angepassten Bestimmung des Teilvermögens AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Bail-in Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf eine frei konvertierbare Währung lauten, zu den zulässigen Anlagen gehören, vgl. § 8 Ziff. 10 lit. a.

Neben den umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

\* \* \*

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, 8. Juni 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich