

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE GLOBAL AGGREGATE

Jahresbericht per 31.10.2023

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	56317906	CHF
GT CHF	37165093	CHF
GTH1 CHF	55641033	CHF
MT CHF	51788899	CHF
NT CHF	3929949	CHF
NTH1 CHF	50718466	CHF
Swiss Red Cross	51196143	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 23. Februar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 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 beigefügten 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 31. Oktober 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	35
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	35
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	36
7	Pauschale Verwaltungskommission	36
8	Benchmark	36
9	TER	36
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	37
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	37
12	Fussnoten	38
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	39
14	Pflichtpublikationen	41

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'005'734'992.77	555'463'493.54	481'962'050.16	298'697'766.91
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		312'910.49	347'532.07	17'722.90	10'027.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'124.042	181.241	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.4168	84.2698	97.7864	100.2768
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		77.4710	84.4046	97.8450	100.4172
Thesaurierung je Anteil		0.88	0.88	0.95	0.18
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'076'863.08	9'681'775.34	14'095'093.39	10'935'860.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		120'411.940	106'347.351	133'504.311	100'694.868
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.6866	91.0392	105.5778	108.6040
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		83.7452	91.1848	105.6412	108.7560
Thesaurierung je Anteil		1.04	1.05	1.15	1.47
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GTH1 CHF 14)					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'580'947.40	114'019'753.23	120'816'266.45	42'826'928.41
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		296'761.300	1'380'846.600	1'248'562.500	430'420.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.4610	82.5724	96.7643	99.5003
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		79.5166	82.7045	96.8224	99.6396
Thesaurierung je Anteil		0.99	0.96	1.05	0.35
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse MT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'801.94	8'466.51	9'793.32	10'032.36
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000	100.000	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		78.0194	84.6651	97.9332	100.3236
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		78.0740	84.8006	97.9920	100.4641
Thesaurierung je Anteil		1.29	1.34	1.45	1.31
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		688'038'351.48	173'299'082.85	143'953'372.04	103'926'420.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		778'834.784	180'766.822	129'811.681	91'340.626
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		883.4202	958.6886	1'108.9401	1'137.7897
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		884.0386	960.2225	1'109.6054	1'139.3826
Thesaurierung je Anteil		14.67	15.28	16.58	19.94
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

	von	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
Klasse NTH1 CHF 14)					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		259'310'603.04	230'454'318.61	170'209'966.24	106'245'671.41
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'126'049.327	2'687'892.858	1'698'150.997	1'030'113.115
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.9515	85.7379	100.2325	103.1398
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		83.0096	85.8751	100.2927	103.2842
Thesaurierung je Anteil		1.38	1.37	1.49	1.77
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse Swiss Red Cross					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'407'515.34	27'652'564.93	32'859'835.82	34'742'825.74
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		327'248.144	337'797.274	343'467.199	349'346.379
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.5841	81.8614	95.6710	99.4509
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		74.6363	81.9924	95.7284	99.5902
Ausschüttung je Anteil inkl. Spende an das Schweiz. Rote Kreuz		0.70	0.80	0.80	1.20
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %	0.70 %	0.70 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF (Lancierung 01.09.2020)	-7.79 %	-14.68 %	-12.79 %	-0.46 %
Klasse GT CHF	-7.69 %	-14.59 %	-12.71 %	0.33 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 16.07.2020)	-3.38 %	-13.53 %	-14.17 %	-
Klasse MT CHF (Lancierung 27.01.2020)	-7.41 %	-14.25 %	-12.28 %	-0.46 %
Klasse NT CHF	-7.33 %	-14.25 %	-12.42 %	0.73 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 06.11.2019)	-2.71 %	-13.02 %	-13.89 %	4.98 %
Klasse Swiss Red Cross (Lancierung 06.04.2020)	-8.06 %	-14.85 %	-12.79 %	-1.45 %
Benchmark Hedge	-2.61 %	-	-	-
Benchmark	-7.50 %	-14.96 %	-1.77 %	-0.32 %
Tracking Error 33)	0.74 %	1.15 %	0.43 %	1.23 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DT CHF (Lancierung 01.09.2020)	-0.29 %
Klasse GT CHF	-0.19 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 16.07.2020)	-0.77 %
Klasse MT CHF (Lancierung 27.01.2020)	0.09 %
Klasse NT CHF	0.17 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 06.11.2019)	-0.10 %
Klasse Swiss Red Cross (Lancierung 06.04.2020)	-0.56 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2023	31.10.2022
Bankguthaben auf Sicht	115'492'262.59	75'413'964.94
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	923'722'696.96	494'208'132.40
Derivative Finanzinstrumente	-16'854'030.06	-9'783'735.00
Sonstige Vermögenswerte	7'147'517.71	3'310'697.09
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'029'508'447.20	563'149'059.43
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-23'745'397.69	-7'629'210.33
Andere Verbindlichkeiten	-28'056.74	-56'355.56
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'005'734'992.77	555'463'493.54

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'124.042	181.241
Ausgegebene Anteile		17.744	3'971.147
Zurückgenommene Anteile		-99.891	-28.346
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'124.042

Klasse GT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		106'347.351	133'504.311
Ausgegebene Anteile		31'169.832	25'482.853
Zurückgenommene Anteile		-17'105.243	-52'639.813
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		120'411.940	106'347.351

Klasse GTH1 CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'380'846.600	1'248'562.500
Ausgegebene Anteile		224'764.100	506'186.100
Zurückgenommene Anteile		-1'308'849.400	-373'902.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		296'761.300	1'380'846.600

Klasse MT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000

Klasse NT CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		180'766.822	129'811.681
Ausgegebene Anteile		633'914.962	112'490.694
Zurückgenommene Anteile		-35'847.000	-61'535.553
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		778'834.784	180'766.822

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'687'892.858	1'698'150.997
Ausgegebene Anteile		1'016'698.809	1'059'532.278
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	160'519.711
Zurückgenommene Anteile		-578'542.340	-230'310.128
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'126'049.327	2'687'892.858

Klasse Swiss Red Cross	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		337'797.274	343'467.199
Ausgegebene Anteile		2'119.337	2'787.013
Zurückgenommene Anteile		-12'668.467	-8'456.938
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		327'248.144	337'797.274

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		555'463'493.54	481'962'050.16
Ausbezahlte Ausschüttung		-268'887.28	-274'510.92
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'174'003.63	-2'389'009.80
Saldo aus dem Anteilverkehr		516'976'238.79	154'253'381.37
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-61'261'848.65	-78'088'417.27
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'005'734'992.77	555'463'493.54

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		133'365.60	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-341'695.59	-294'608.80
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		15'541'583.62	8'097'155.99
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'771'420.98	1'906'107.62
Total Ertrag		17'104'674.61	9'708'654.81
Aufwand			
Passivzinsen		-2'545.10	-5'949.76
Reglementarische Vergütungen		-319'781.38	-722'989.45
Sonstige Aufwendungen		0.00	-76.69
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-381'185.21	-852'824.73
Total Aufwand		-703'511.69	-1'581'840.63
Nettoertrag / Verlust		16'401'162.92	8'126'814.18
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-53'513'519.58	-27'648'982.19
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		944'833.62	294'275.21
Realisierter Erfolg		-36'167'523.04	-19'227'892.80
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-25'094'325.61	-58'860'524.47
Gesamterfolg		-61'261'848.65	-78'088'417.27

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	3'564.65	3'649.76
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'564.65	3'649.76
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'247.63	1'277.42
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'317.02	2'372.34
Total	3'564.65	3'649.76
Klasse GT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	125'318.57	112'275.65
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	125'318.57	112'275.65
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	43'861.50	39'296.48
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	81'457.07	72'979.17
Total	125'318.57	112'275.65
Klasse GTH1 CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	296'121.45	1'327'204.78
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	296'121.45	1'327'204.78
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	103'642.51	464'521.67
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	192'478.94	862'683.11
Total	296'121.45	1'327'204.78
Klasse MT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	129.49	134.74
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	129.49	134.74
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	45.32	47.16
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	84.17	87.58
Total	129.49	134.74
Klasse NT CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	11'425'569.62	2'762'513.03
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	11'425'569.62	2'762'513.03
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'998'949.37	966'879.56
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'426'620.25	1'795'633.47
Total	11'425'569.62	2'762'513.03
Klasse NTH1 CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	4'323'847.67	3'691'301.56
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'323'847.67	3'691'301.56
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'513'346.68	1'291'955.55
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'810'500.99	2'399'346.01
Total	4'323'847.67	3'691'301.56
Klasse Swiss Red Cross	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	226'611.47	229'734.66
Vortrag des Vorjahres	10'870.66	51'373.82
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	237'482.13	281'108.48
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	114'536.85	135'118.91
Zur Ausschüttung an das Schweizerische Rote Kreuz vorgesehener Erfolg	114'536.85	135'118.91
Vortrag auf neue Rechnung	8'408.43	10'870.66
Total	237'482.13	281'108.48

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							923'722'696.96	89.72	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							923'722'696.96	89.72	
AU3CB0250512	4.7500 % EBIUH 4 3/4 02/09/28 MTN	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	15'000	0	15'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2300313041	0.1250 % FABUH 0 1/8 02/16/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	90.92%	1'749'225.25	0.17	a)
XS2651619285	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN	0	2'450	2'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
AE							1'749'225.25	0.17	
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US676167BX63	3.1250 % OKB 3 1/8 11/07/23	1'750	3'250	2'500	2'500 USD	99.97%	2'274'442.46	0.22	a)
US676167CC18	0.5000 % OKB 0 1/2 02/02/26 GMTN	2'750	0	2'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2320746394	0.9000 % VERA V 0.9 04/01/41	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT							2'274'442.46	0.22	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	8'500	2'000	6'500 AUD	71.30%	2'670'203.11	0.26	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	0	5'250	1'500	3'750 AUD	95.61%	2'065'843.26	0.20	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	1'750	250	0	2'000 AUD	48.61%	560'214.42	0.05	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	3'000	3'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	1'000	0	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	500	3'000	3'000	500 AUD	90.73%	261'403.82	0.03	a)
AU3CB0272888	1.6000 % SGT OPT 1.6 07/01/25 MTN	500	0	0	500 AUD	94.22%	271'432.55	0.03	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	0	4'000	2'000	2'000 AUD	92.77%	1'069'089.59	0.10	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	0	1'550	0	1'550 AUD	76.57%	683'843.21	0.07	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TC V 2 09/17/35	4'500	2'750	0	7'250 AUD	66.60%	2'782'256.36	0.27	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	500	0	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
JP503604AJ75	0.3200 % WSTP 0.32 07/06/23 12	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	100'000	0	0	100'000 JPY	99.97%	600'736.74	0.06	a)
US05253JAL52	3.7000 % ANZ 3.7 11/16/25 MTN	2'000	0	1'000	1'000 USD	96.30%	876'391.08	0.09	a)
US05253JAX90	5.3750 % ANZ 5 3/8 07/03/25	0	1'900	0	1'900 USD	99.56%	1'721'443.01	0.17	a)
US05253JAY73	5.6710 % ANZ 5.671 10/03/25	0	5'000	0	5'000 USD	100.15%	4'556'936.00	0.44	a)
US2027A1KH95	2.2960 % CBAAU 2.296 03/14/25 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6325C1D228	1.3880 % NAB 1.388 01/12/25 REGS	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	0	3'950	3'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AU							18'119'793.15	1.76	
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	5'500	0	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	0	3'750	750	3'000 EUR	96.28%	2'778'429.11	0.27	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	5'500	0	5'500 EUR	86.15%	4'557'849.23	0.44	a)
BE							7'336'278.34	0.71	
CA07813ZBZ68	3.3500 % BCECN 3.35 03/12/25 MTN	1'000	0	0	1'000 CAD	96.97%	635'682.40	0.06	a)
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	1'000	4'000	0	5'000 CAD	67.66%	2'217'627.71	0.22	a)
CA110709GC03	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/44	0	1'000	0	1'000 CAD	77.08%	505'287.46	0.05	a)
CA110709GJ55	2.9500 % BRCOL 2.95 06/18/50	1'000	2'000	0	3'000 CAD	71.11%	1'398'503.61	0.14	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	3'000	3'500	5'750	750 CAD	81.67%	401'547.89	0.04	a)
CA135087H987	2.0000 % CAN 2 09/01/23	400	0	400	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	500	750	1'250	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L369	0.2500 % CAN 0 1/4 11/01/22	2'200	0	2'200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	3'300	0	3'300 CAD	78.24%	1'692'458.98	0.16	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	0	3'000	3'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	0	7'500	0	7'500 CAD	98.09%	4'822'724.20	0.47	a)
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	0	1'000	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	1'000	0	0	1'000 CAD	62.74%	411'258.04	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	1'250	2'500	750	3'000 CAD	90.69%	1'783'532.81	0.17	a)
CA13509PHM82	1.7500 % CANHOU 1 3/4 06/15/30	3'250	3'250	6'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA136375CX83	3.0500 % CNRCN 3.05 02/08/50	0	1'500	0	1'500 CAD	66.73%	656'123.81	0.06	a)
CA44810ZBZ23	3.0200 % HYDONE 3.02 04/05/29 MTN	1'250	0	0	1'250 CAD	90.60%	742'411.16	0.07	a)
CA68333ZAN74	1.3500 % ONT 1.35 12/02/30	0	3'750	750	3'000 CAD	80.16%	1'576'449.38	0.15	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	5'300	1'000	0	6'300 CAD	84.31%	3'481'991.90	0.34	a)
CA69363TAN24	2.0500 % PSPCAP 2.05 01/15/30 12	0	3'000	0	3'000 CAD	86.18%	1'694'868.87	0.16	a)
CA74814ZFM01	2.1000 % Q 2.1 05/27/31	0	3'500	0	3'500 CAD	83.74%	1'921'372.90	0.19	a)
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	0	6'000	0	6'000 CAD	94.55%	3'718'770.01	0.36	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	50	0	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	0	10'000	3'100	6'900 USD	99.96%	6'277'084.44	0.61	a)
US013051EF00	2.9500 % ALTA 2.95 01/23/24	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06368D3513	3.7000 % BMO 3.7 06/07/25 MTN	0	3'000	0	3'000 USD	96.40%	2'631'806.53	0.26	a)
US06368FAC32	1.2500 % BMO 1 1/4 09/15/26 MTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0778FFAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AD48	1.7500 % BRCOL 1 3/4 09/27/24 10	4'000	4'000	4'000	4'000 USD	96.58%	3'515'595.95	0.34	a)
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	0	4'000	2'000	2'000 USD	89.38%	1'626'737.33	0.16	a)
US11070TAM09	4.2000 % BRCOL 4.2 07/06/33	0	10'000	0	10'000 USD	91.10%	8'290'558.69	0.81	a)
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	1'000	1'000	0	2'000 USD	69.14%	1'258'491.93	0.12	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	500	4'500	3'000	2'000 USD	77.17%	1'404'617.56	0.14	a)
US22411WAG15	3.1250 % CPPIBC 3 1/8 09/25/23 REGS	2'000	1'200	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22411WAM82	1.2500 % CPPIBC 1 1/4 03/04/25 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	3'900	0	0	3'900 USD	84.17%	2'987'275.13	0.29	a)
US683234AR91	1.1250 % ONT 1 1/8 10/07/30	0	5'161	0	5'161 USD	76.45%	3'590'845.11	0.35	a)
US683234C895	1.7500 % ONT 1 3/4 01/24/23	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US683234FC36	3.0500 % ONT 3.05 01/29/24	0	4'500	0	4'500 USD	99.38%	4'069'793.65	0.40	a)
US683234FH23	1.6000 % ONT 1.6 02/25/31	1'500	3'500	0	5'000 USD	78.17%	3'556'791.10	0.35	a)
US69376QA05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	1'500	3'500	0	5'000 USD	95.52%	4'346'489.81	0.42	a)
US69376QB87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	6'000	2'000	2'000	6'000 USD	84.48%	4'613'079.85	0.45	a)
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	1'000	2'000	1'000	2'000 USD	78.66%	1'431'733.51	0.14	a)
US748148SC86	0.6000 % Q 0.6 07/23/25	0	3'000	1'000	2'000 USD	92.26%	1'679'191.46	0.16	a)
US748149AN17	2.7500 % Q 2 3/4 04/12/27	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	0	7'000	0	7'000 USD	98.63%	6'283'203.61	0.61	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	0	2'200	0	2'200 USD	90.41%	1'810'016.49	0.18	a)
US89114QCB23	3.2500 % TD 3 1/4 03/11/24 GMTN	900	4'100	0	5'000 USD	99.06%	4'507'568.66	0.44	a)
US89114TZE53	0.7000 % TD 0.7 09/10/24 MTN	3'000	0	0	3'000 USD	95.71%	2'612'971.96	0.25	a)
US89114TZN52	1.9500 % TD 1.95 01/12/27 FXD	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	89.75%	2'450'418.83	0.24	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	2'000	3'800	0	5'800 USD	89.22%	4'709'343.12	0.46	a)
USC8888MBN77	4.7010 % TD 4.701 06/05/26 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	98.11%	3'571'545.83	0.35	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	1'850	0	0	1'850 AUD	84.07%	896'168.78	0.09	a)
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	550	0	0	550 GBP	36.35%	220'795.43	0.02	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTFT 0.95 11/24/51 EMTN	500	0	0	500 EUR	47.00%	226'062.40	0.02	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	2'400	0	0	2'400 EUR	92.40%	2'133'053.24	0.21	a)
XS2592761527	4.3750 % CPPIBC 4 3/8 03/02/26 EMTN	0	750	750	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	100.93%	1'114'559.12	0.11	a)
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	0	8'000	0	8'000 EUR	98.90%	7'610'994.99	0.74	a)
CA							117'087'405.64	11.37	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	3'000	2'000	1'000 CHF	99.36%	993'600.00	0.10	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	4'000	3'000	1'000 CHF	99.31%	993'100.00	0.10	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	0	1'000	0	1'000 CHF	87.81%	878'100.00	0.09	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	1'500	1'500	1'000	2'000 CHF	94.90%	1'898'000.00	0.18	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	750	1'250	0	2'000 CHF	79.20%	1'584'000.00	0.15	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	1'000	1'500	0	2'500 CHF	95.69%	2'392'250.00	0.23	a)
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	3'400	2'600	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	3'200	0	3'200 EUR	99.21%	3'053'817.18	0.30	a)
US22546QAP28	3.6250 % CS 3 5/8 09/09/24 MTN	0	10'000	0	10'000 USD	97.63%	8'884'727.15	0.86	a)
USH3698DB520	4.2070 % CS 4.207 06/12/24 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USH42097BT36	1.3640 % UBS 1.364 01/30/27 REGS	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097CU99	3.1790 % UBS 3.179 02/11/43 REGS	0	6'000	2'000	4'000 USD	62.36%	2'270'101.52	0.22	a)
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2345981802	1.1250 % CS 1 1/8 12/15/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2575155671	7.7500 % CS 7 3/4 03/10/26 EMTN	0	1'500	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2589907653	5.5000 % CS 5 1/2 08/20/26 EMTN	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH							22'947'695.85	2.23	
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	0	3'000	0	3'000 USD	65.01%	1'774'819.54	0.17	a)
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	98.98%	1'189'611.49	0.12	a)
XS2369244087	0.1000 % CHILE 0.1 01/26/27	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CL							2'964'431.03	0.29	
XS2280441721	2.8000 % BCHINA 2.8 01/14/23 EMTN	5'000	0	5'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS232559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	99.54%	2'467'480.61	0.24	a)
CN							2'467'480.61	0.24	
CZ0001005037	0.2500 % CZGB 0 1/4 02/10/27 100	0	30'000	0	30'000 CZK	87.33%	1'025'244.40	0.10	a)
XS2495084621	5.6250 % CESDRA 5 5/8 10/12/27	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CZ							1'025'244.40	0.10	
DE0001030567	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/26 VL	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102309	1.5000 % DBR 1 1/2 02/15/23	2'300	1'000	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102325	2.0000 % DBR 2 08/15/23	0	26'100	26'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	2'000	2'750	4'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	19'000	18'250	750 EUR	92.61%	668'159.10	0.06	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	5'500	0	5'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	0	18'500	18'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	0	5'000	3'000	2'000 EUR	80.15%	1'541'968.52	0.15	a)
DE000A14JZH9	0.0100 % BADWUR 0.01 04/08/25	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	0	5'450	5'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V5C3	5.3750 % DB 5 3/8 01/11/29	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	0	6'000	3'000	3'000 EUR	98.51%	2'842'782.01	0.28	a)
DE000A30VHW7	1.5000 % NIESA 1 1/2 10/17/29	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	97.44%	1'874'564.30	0.18	a)
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3E5SL5	2.5000 % BRABUR 2 1/2 01/25/29	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP5P6	0.0100 % LANDER 0.01 10/08/27 61	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	3'600	0	0	3'600 EUR	90.80%	3'144'172.88	0.31	a)
DE000A3MQYP1	2.7500 % BERGER 2 3/4 02/14/33 546	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3MQYR7	3.0000 % BERGER 3 05/04/28 548	0	7'000	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19VD6	1.3750 % DB 1 3/8 06/10/26 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19WU8	3.2500 % DB 3 1/4 05/24/28	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MK0	0.0000 % NRW 0 01/15/29	0	2'500	0	2'500 EUR	84.66%	2'035'941.93	0.20	a)
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0NP7	3.0000 % NRW 3 01/27/28	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	0	3'000	0	3'000 USD	97.61%	2'664'844.81	0.26	a)
US30254WAN92	2.7500 % FMSWER 2 3/4 03/06/23	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30254WAP41	2.7500 % FMSWER 2 3/4 01/30/24	3'000	4'500	3'000	4'500 USD	99.32%	4'067'213.66	0.40	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	140'000	1'085'000	0	1'225'000 JPY	104.21%	7'671'088.20	0.75	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	500'000	0	0	500'000 JPY	119.81%	3'599'649.66	0.35	a)
US500769GK42	2.5000 % KFW 2 1/2 11/20/24	0	5'000	0	5'000 USD	96.90%	4'409'390.28	0.43	a)
US500769GQ12	2.0000 % KFW 2 05/02/25	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JC98	1.3750 % KFW 1 3/8 08/05/24	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JR67	1.2500 % KFW 1 1/4 01/31/25	0	6'000	0	6'000 USD	95.00%	5'187'208.45	0.50	a)
US500769JT24	3.0000 % KFW 3 05/20/27	2'000	6'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JV79	3.3750 % KFW 3 3/8 08/23/24	0	10'000	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD5558XAA66	5.8750 % MUNRE 5 7/8 05/23/42 REGS	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1551675488	2.3750 % RENTEN 2 3/8 01/23/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 USD	99.28%	903'452.14	0.09	a)
XS2193666125	0.8750 % DBHNGR 0 7/8 06/23/39 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	0	6'000	0	6'000 EUR	78.08%	4'506'434.25	0.44	a)
XS2307309893	1.0000 % RENTEN 1 02/25/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 USD	84.64%	3'851'194.73	0.37	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	0	0	25'000 CNY	99.87%	3'094'731.61	0.30	a)
XS2345827120	0.2500 % ERSTAA 0 1/4 08/25/23 EMTN	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	1'000	2'592	3'592	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	2'700	0	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 PLN	99.40%	643'969.44	0.06	a)
XS2448404009	1.6250 % KFW 1 5/8 05/10/24 GMTN	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2451376219	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 03/03/34 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	78.63%	3'781'911.05	0.37	a)
XS2485162163	2.2500 % EVKGR 2 1/4 09/25/27 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2541394750	3.8750 % DBHNGR 3 7/8 10/13/42 EMTN	575	0	575	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	0	100'000	0	100'000 CNY	100.32%	12'434'580.18	1.21	a)
DE							68'923'257.20	6.69	
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	6'500	250	0	6'750 DKK	87.13%	757'999.52	0.07	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	0	5'500	0	5'500 DKK	96.58%	684'599.21	0.07	a)
DK0009924375	0.0000 % DGB 0 11/15/31 G	0	7'000	0	7'000 DKK	79.36%	715'931.93	0.07	a)
XS2556930696	4.2500 % KOMMUN 4 1/4 11/17/25 EMTN	0	1'500	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2615916850	3.3750 % KOMMUN 3 3/8 04/26/43 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	93.69%	1'081'509.59	0.11	a)
DK							3'240'040.25	0.31	
XS2532370231	4.0000 % ESTONI 4 10/12/32	2'750	0	2'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EE							0.00	0.00	
AU3CB0297596	5.6780 % SANTAN 5.678 03/09/28 FXD	0	2'850	0	2'850 AUD	97.27%	1'597'350.08	0.16	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	225	0	225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	0	4'000	2'000	2'000 EUR	46.26%	889'936.12	0.09	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	0	12'000	0	12'000 EUR	65.66%	7'579'443.80	0.74	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	3'000	10'500	1'500	12'000 EUR	78.45%	9'055'462.62	0.88	a)
ES0200002089	3.9000 % ADIFAL 3.9 04/30/33 EMTN	0	3'700	3'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	98.92%	5'709'400.56	0.55	a)
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	100'000	0	0	100'000 JPY	99.51%	597'961.20	0.06	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	1'200	0	0	1'200 USD	97.37%	1'063'347.77	0.10	a)
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	0	5'000	0	5'000 USD	99.71%	4'537'099.78	0.44	a)
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	1'600	900	0	2'500 GBP	81.84%	2'259'480.97	0.22	a)
XS2436160183	1.3750 % ANESM 1 3/8 01/26/32 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634826031	4.2500 % SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN	0	4'100	0	4'100 EUR	99.60%	3'928'242.23	0.38	a)
ES							37'217'725.13	3.62	
XS1964628991	2.5000 % KUNTA 2 1/2 11/15/23 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.92%	909'321.96	0.09	a)
XS2197690915	0.3750 % KUNTA 0 3/8 09/01/23 REGS	4'000	2'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FI							909'321.96	0.09	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	500	0	0	500 AUD	90.56%	260'902.53	0.03	a)
FR0010466938	4.2500 % FRTR 4 1/4 10/25/23	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011951771	1.8750 % AIFP 1 7/8 06/05/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012146801	1.7500 % SANFP 1 3/4 09/10/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013217114	0.8750 % ORAFP 0 7/8 02/03/27 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	93.85%	1'127'958.02	0.11	a)
FR0013476199	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/15/26	0	2'900	2'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013509890	0.7500 % AGFRNC 0 3/4 04/28/23 EMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	0	10'000	0	10'000 EUR	59.98%	5'769'636.41	0.56	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	0	10'000	0	10'000 EUR	98.85%	9'508'741.72	0.92	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	1'500	4'500	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003CJ5	0.8750 % SOGRPR 0 7/8 05/10/46 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	50.96%	490'168.99	0.05	a)
FR0014006NI7	0.5000 % BNP 0 1/2 05/30/28 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140095D5	0.5000 % CFF 0 1/2 03/16/28 EMTN	3'000	1'000	0	4'000 EUR	87.74%	3'376'093.41	0.33	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0014009062	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	0	14'500	4'500	10'000 EUR	72.39%	6'963'387.45	0.68	a)
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	2'500	1'500	0	4'000 EUR	89.14%	3'429'922.83	0.33	a)
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	1'600	1'400	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F6X7	3.5000 % SOGRPR 3 1/2 05/25/43 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	2'800	0	2'800 EUR	82.43%	2'220'165.32	0.22	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I3C5	3.4700 % BNFP 3.47 05/22/31 EMTN	0	3'800	300	3'500 EUR	97.10%	3'269'006.92	0.32	a)
FR001400I4X9	4.1250 % BNP 4 1/8 05/24/33 EMTN	0	8'000	4'000	4'000 EUR	97.73%	3'760'248.46	0.37	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	0	1'700	700	1'000 GBP	100.07%	1'105'084.22	0.11	a)
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	0	3'000	0	3'000 EUR	96.97%	2'798'340.99	0.27	a)
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	0	5'900	0	5'900 EUR	100.25%	5'689'612.19	0.55	a)
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	0	6'200	0	6'200 EUR	99.56%	5'937'465.68	0.58	a)
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	0	800'000	0	800'000 JPY	98.70%	4'744'922.00	0.46	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	785	3'000	0	3'785 USD	99.57%	3'429'589.95	0.33	a)
US801060AC87	3.3750 % SANFP 3 3/8 06/19/23	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	94.24%	2'572'756.85	0.25	a)
XS1046806821	3.3750 % CADES 3 3/8 03/20/24 REGS	3'000	10'000	3'000	10'000 USD	99.14%	9'022'326.71	0.88	a)
XS2247546711	1.0000 % CADES 1 10/21/30 REGS	1'500	4'000	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2345996230	0.3750 % CADES 0 3/8 05/27/24 REGS	0	6'000	1'000	5'000 USD	97.05%	4'416'199.64	0.43	a)
FR							79'892'530.29	7.76	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	200	0	0	200 AUD	97.40%	112'238.79	0.01	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	250	0	0	250 AUD	97.99%	141'152.70	0.01	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	0	2'750	0	2'750 GBP	42.15%	1'280'021.93	0.12	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	0	1'300	0	1'300 GBP	76.30%	1'095'355.34	0.11	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	400	1'400	1'800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	6'500	0	6'500 GBP	60.13%	4'316'102.00	0.42	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	1'750	8'500	3'150	7'100 GBP	71.48%	5'604'411.71	0.54	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'700	800	1'000	2'500 GBP	46.69%	1'288'994.37	0.13	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	1'800	3'200	0	5'000 GBP	36.10%	1'993'261.81	0.19	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	0	2'850	2'850	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	2'000	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	2'750	1'750	1'500	3'000 GBP	63.86%	2'115'618.27	0.21	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	0	1'000	0	1'000 GBP	88.93%	982'054.14	0.10	a)
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	0	600'000	600'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US046353AX64	2.1250 % AZN 2 1/8 08/06/50	0	4'000	2'000	2'000 USD	51.39%	935'416.32	0.09	a)
US06738EAN58	4.3750 % BACR 4 3/8 01/12/26	0	4'000	0	4'000 USD	95.43%	3'473'910.42	0.34	a)
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	0	1'800	0	1'800 USD	97.62%	1'599'116.85	0.16	a)
US06739FHV67	3.7500 % BACR 3 3/4 05/15/24 BKNT	0	4'000	0	4'000 USD	98.85%	3'598'410.50	0.35	a)
US539439AP41	2.9070 % LLOYDS 2.907 11/07/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US539439AV19	2.4380 % LLOYDS 2.438 02/05/26	3'000	0	0	3'000 USD	94.80%	2'588'250.48	0.25	a)
US53944YAR45	3.5110 % LLOYDS 3.511 03/18/26	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US53944YAS28	3.7500 % LLOYDS 3 3/4 03/18/28	0	6'000	0	6'000 USD	91.12%	4'975'279.02	0.48	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	1'300	2'700	0	4'000 USD	86.83%	3'160'920.86	0.31	a)
US63859UBE29	2.0000 % NWISE 2 01/27/23 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG6398ADC83	1.7000 % NWISE 1.7 02/13/23 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1721422068	1.8750 % VOD 1 7/8 11/20/29 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1788982996	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 09/07/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1950827078	2.6250 % UU 2 5/8 02/12/31 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2021471433	0.3750 % MOTOPG 0 3/8 01/03/26 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	97.20%	2'146'803.70	0.21	a)
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	0	300 GBP	58.63%	194'241.98	0.02	a)
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	200	1'000	200	1'000 GBP	56.01%	618'496.44	0.06	a)
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	5'000	2'000	1'000	6'000 USD	90.08%	4'918'774.31	0.48	a)
XS2355184149	3.4000 % HSBC 3.4 06/29/27 EMTN	30'000	0	30'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	3'700	0	1'700	2'000 USD	82.04%	1'493'164.97	0.15	a)
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	87.92%	1'200'187.59	0.12	a)
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2445344570	2.6250 % SVTLN 2 5/8 02/22/33 EMTN	0	2'750	750	2'000 GBP	75.63%	1'670'452.78	0.16	a)
XS2450201046	2.1250 % UNANA 2 1/8 02/28/28 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2462446696	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/29/38 EMTN	550	0	0	550 GBP	74.22%	450'780.30	0.04	a)
XS2507889835	2.7500 % IFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	750	0	750	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2574870759	3.5000 % MOTOPG 3 1/2 07/17/31 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	95.72%	5'524'537.48	0.54	a)
XS2576255249	4.2500 % NWG 4 1/4 01/13/28 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2587306403	3.8200 % SGELN 3.82 02/15/28 EMTN	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	2'900	400	2'500 EUR	99.04%	2'381'706.49	0.23	a)
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	0	4'400	2'400	2'000 EUR	97.37%	1'873'217.60	0.18	a)
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	4'800	0	4'800 EUR	98.47%	4'546'789.00	0.44	a)
GB							66'279'668.15	6.44	
HK0000929684	3.7500 % HKINTL 3 3/4 06/07/32 GMTN	0	850	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP534411AK62	0.2040 % HSBC 0.204 06/25/24 3	100'000	0	0	100'000 JPY	99.75%	599'408.72	0.06	a)
HK							599'408.72	0.06	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	3'000	3'000	3'000	3'000 USD	76.05%	2'076'210.11	0.20	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	87.47%	965'898.23	0.09	a)
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	3'400	0	3'400 EUR	96.55%	3'157'618.69	0.31	a)
IE							6'199'727.03	0.60	
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	1'000	1'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	0	3'000	1'000	2'000 EUR	80.67%	1'552'030.27	0.15	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	0	3'500	0	3'500 EUR	61.96%	2'085'899.59	0.20	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	0	4'000	0	4'000 EUR	93.03%	3'579'406.24	0.35	a)
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	8'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	0	1'300'000	0	1'300'000 JPY	99.93%	7'806'218.47	0.76	a)
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	0	4'000	2'000	2'000 EUR	89.73%	1'726'215.96	0.17	a)
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.68%	5'989'580.39	0.58	a)
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2625196352	4.8750 % ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2630420268	6.6250 % ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN	0	2'000	0	2'000 GBP	95.23%	2'103'228.02	0.20	a)
IT							24'842'578.94	2.41	
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.55%	1'196'398.11	0.12	a)
JP316572BMA4	0.1000 % NTT 0.1 09/18/26 21	200'000	0	0	200'000 JPY	98.88%	1'188'376.21	0.12	a)
US62954WAC91	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 144A	0	8'000	0	8'000 USD	89.76%	6'535'181.10	0.63	a)
XS0241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	500	0	0	500 GBP	88.96%	491'214.80	0.05	a)
XS2197348324	0.7500 % TACHEM 0 3/4 07/09/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2411311579	0.0820 % NTT 0.082 12/13/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	94.98%	1'918'558.98	0.19	a)
JP							11'329'729.20	1.10	
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	0	5'000'000	0	5'000'000 KRW	94.94%	3'198'824.24	0.31	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	0	5'000'000	0	5'000'000 KRW	72.82%	2'453'432.30	0.24	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	0	1'000'000	0	1'000'000 KRW	67.14%	452'442.32	0.04	a)
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	60.43%	1'221'546.64	0.12	a)
KR103502GAC2	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/30 3012	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	83.04%	1'678'569.98	0.16	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	0	5'000'000	0	5'000'000 KRW	91.59%	3'085'928.28	0.30	a)
US500630CW64	3.2500 % KDB 3 1/4 02/19/24	4'000	0	0	4'000 USD	99.24%	3'612'570.88	0.35	a)
US500630DF23	0.4000 % KDB 0.4 06/19/24	0	7'000	0	7'000 USD	96.73%	6'162'166.96	0.60	a)
US500630DT27	4.0000 % KDB 4 09/08/25	2'345	0	0	2'345 USD	97.22%	2'074'638.25	0.20	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	0	4'300	0	4'300 USD	99.90%	3'909'389.29	0.38	a)
XS2427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2623871196	3.3750 % KDB 3 3/8 05/23/28 EMTN	0	6'500	3'500	3'000 EUR	98.81%	2'851'468.20	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KR							30'700'977.34	2.98	
XS1371533867	3.5000 % THAMES 3 1/2 02/25/28 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAB4	0.8750 % EFSF 0 7/8 09/05/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	0	3'600	0	3'600 EUR	101.12%	3'501'686.41	0.34	a)
XS2375844144	0.3340 % BDX 0.334 08/13/28	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2375844656	1.3360 % BDX 1.336 08/13/41	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2447550893	3.0000 % PRIFII 3 02/22/42 EMTN	450	0	0	450 GBP	63.94%	317'735.32	0.03	a)
XS2585932275	3.5530 % BDX 3.553 09/13/29	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU							3'819'421.73	0.37	
US02364WBE49	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 07/16/42	0	5'000	2'000	3'000 USD	76.67%	2'093'308.90	0.20	a)
US02364WBJ36	2.8750 % AMXLMM 2 7/8 05/07/30	0	6'000	0	6'000 USD	82.37%	4'497'840.98	0.44	a)
XS2363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
MX							6'591'149.88	0.64	
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	1'500	1'000	0	2'500 AUD	94.43%	1'360'317.43	0.13	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	1'000	1'000	0	2'000 AUD	90.03%	1'037'479.36	0.10	a)
US21685WCJ45	5.2500 % RABOBK 5 1/4 05/24/41 BKNT	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82620KAZ66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 144A	2'000	0	0	2'000 USD	90.39%	1'645'140.78	0.16	a)
US82620KBF93	2.8750 % SIEGR 2 7/8 03/11/41 144A	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN2557FFL33	4.3750 % DT 4 3/8 06/21/28 REGS	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN82008A571	3.1250 % SIEGR 3 1/8 03/16/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN82008AZ15	1.7000 % SIEGR 1.7 03/11/28 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0877608124	2.5000 % BNG 2 1/2 01/23/23 REGS	7'500	0	7'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	1'650	4'000	650	5'000 EUR	74.77%	3'596'163.01	0.35	a)
XS1881598772	3.0000 % BNG 3 09/20/23 REGS	0	5'792	5'792	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2182093943	1.0000 % BNG 1 06/03/30 REGS	0	5'440	0	5'440 USD	76.84%	3'804'294.39	0.37	a)
XS2204965540	0.2500 % NEDWBK 0 1/4 12/15/25 EMTN	0	2'250	0	2'250 GBP	90.32%	2'244'158.81	0.22	a)
XS232592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	0	7'250	0	7'250 EUR	73.10%	5'097'692.12	0.50	a)
XS2381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	0	7'500	0	7'500 EUR	85.52%	6'169'581.48	0.60	a)
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	2'100	0	0	2'100 EUR	72.77%	1'470'007.74	0.14	a)
XS2436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	0	11'500	3'500	8'000 USD	98.36%	7'160'637.42	0.70	a)
XS2485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	0	8'000	0	8'000 USD	98.42%	7'165'515.29	0.70	a)
XS2549715618	4.7500 % TENN 4 3/4 10/28/42 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	0	1'350	0	1'350 EUR	96.42%	1'252'163.08	0.12	a)
XS2697483118	4.1250 % INTNED 4 1/8 10/02/26 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL							42'003'150.91	4.08	
NO0010646813	2.0000 % NGB 2 05/24/23 475	1'000	0	1'000	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	200	0	0	200 NOK	94.24%	15'353.47	0.00	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	1'300	0	0	1'300 NOK	91.71%	97'119.41	0.01	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	2'300	0	0	2'300 NOK	96.02%	179'896.19	0.02	a)
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	3'000	0	1'500	1'500 USD	85.53%	1'167'548.65	0.11	a)
XS1748257851	2.5000 % KBN 2 1/2 01/11/23 REGS	2'950	0	2'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	0	1'200	0	1'200 USD	97.72%	1'067'204.71	0.10	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	2'500	11'500	0	14'000 USD	77.57%	9'883'215.80	0.96	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	4'400	2'000	2'400	4'000 EUR	88.90%	3'420'726.81	0.33	a)
XS2537112059	3.7500 % KBN 3 3/4 09/26/25 EMTN	2'000	2'000	1'000	3'000 GBP	97.16%	3'218'648.49	0.31	a)
XS2631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2631835332	3.5000 % STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN	0	2'950	2'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NO							19'049'713.53	1.85	
AU3CB0239754	2.9000 % AUCCCN 2.9 09/16/27	500	0	0	500 AUD	90.29%	260'124.66	0.03	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	2'000	5'250	2'000	5'250 NZD	97.30%	2'704'064.09	0.26	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	2'000	1'500	0	3'500 NZD	79.59%	1'474'536.03	0.14	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	0	3'100	0	3'100 USD	97.44%	2'748'848.80	0.27	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	3'400	1'000	1'400	3'000 USD	88.34%	2'411'896.41	0.23	a)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	75.20%	2'737'321.19	0.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	0	4'500	500	4'000 USD	97.55%	3'550'942.30	0.34	a)
XS2012047127	0.3750 % BZLNZ 0 3/8 09/14/24 GMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 EUR	76.67%	2'950'075.31	0.29	a)
XS2381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	2'500	1'000	500	3'000 EUR	82.78%	2'388'762.22	0.23	a)
NZ							21'226'571.01	2.06	
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	1'000	13'500	0	14'500 SEK	99.93%	1'180'235.30	0.11	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	6'000	2'000	0	8'000 SEK	98.58%	642'380.37	0.06	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	6'000	0	0	6'000 SEK	93.89%	458'844.75	0.04	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	1'500	4'500	0	6'000 SEK	90.67%	443'117.74	0.04	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	0	0	5'000 SEK	81.12%	330'362.65	0.03	a)
SE0015193313	0.5000 % SGB 0 1/2 11/24/45 #1063 1063	1'000	0	0	1'000 SEK	58.97%	48'034.68	0.00	a)
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	98.99%	1'784'579.48	0.17	a)
XS2218776248	0.2500 % KOMINS 0 1/4 12/01/22 REGS	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	1'500	0	0	1'500 SEK	83.04%	101'454.65	0.01	a)
XS2311395169	0.3750 % KOMINS 0 3/8 06/19/24 REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2474788929	2.7500 % KOMINS 2 3/4 03/01/25 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	96.41%	4'386'896.03	0.43	a)
XS2490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	98.14%	1'786'300.74	0.17	a)
XS2496002614	3.2500 % KOMINS 3 1/4 01/16/24 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	99.51%	3'622'253.81	0.35	a)
XS2572496623	4.2500 % SWEDA 4 1/4 07/11/28 GMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SE							14'784'460.20	1.44	
US24023LAF31	1.1940 % DBSSP 1.194 03/15/27 REGS	1'100	2'400	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	2'200	0	0	2'200 USD	90.57%	1'813'373.76	0.18	a)
SG							1'813'373.76	0.18	
XS2635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	0	3'400	0	3'400 USD	95.20%	2'945'649.84	0.29	a)
SI							2'945'649.84	0.29	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOSPO 5 3/8 10/04/28 EMTN	0	1'300	0	1'300 EUR	100.50%	1'256'694.72	0.12	a)
SK							1'256'694.72	0.12	
US36830DAC56	4.3000 % PTTGC 4.3 03/18/51 REGS	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
TH							0.00	0.00	
CA060505FJ83	3.3010 % BAC 3.301 04/24/24 MPLE	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US001055AQ51	2.8750 % AFL 2 7/8 10/15/26	0	8'000	0	8'000 USD	92.34%	6'722'452.49	0.65	a)
US001055AY85	4.7500 % AFL 4 3/4 01/15/49	0	4'000	0	4'000 USD	79.56%	2'896'101.26	0.28	a)
US00206RCU41	5.6500 % T 5.65 02/15/47	1'500	0	0	1'500 USD	88.03%	1'201'614.48	0.12	a)
US00206RKA94	3.6500 % T 3.65 06/01/51	0	6'000	4'000	2'000 USD	61.42%	1'117'835.35	0.11	a)
US00206RKF81	3.5000 % T 3 1/2 02/01/61	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RML32	1.7000 % T 1.7 03/25/26	0	5'000	0	5'000 USD	90.77%	4'130'380.60	0.40	a)
US00287YAS81	4.7000 % ABBV 4.7 05/14/45	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	2'500	0	0	2'500 USD	87.15%	1'982'761.59	0.19	a)
US00287YBZ16	2.6000 % ABBV 2.6 11/21/24	0	3'000	0	3'000 USD	96.65%	2'638'694.94	0.26	a)
US00287YCB39	4.2500 % ABBV 4 1/4 11/21/49	1'000	1'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00846UAM36	2.1000 % A 2.1 06/04/30	0	2'000	0	2'000 USD	77.97%	1'419'167.95	0.14	a)
US02079KAB35	3.3750 % GOOGL 3 3/8 02/25/24	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	200	1'800	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAG22	2.2500 % GOOGL 2 1/4 08/15/60	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135AN60	3.8000 % AMZN 3.8 12/05/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CH74	3.6000 % AMZN 3.6 04/13/32	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816CV93	3.3750 % AXP 3 3/8 05/03/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	0	1'100	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03040WAV72	4.1500 % AWK 4.15 06/01/49	1'000	0	0	1'000 USD	72.51%	659'873.84	0.06	a)
US03040WAY12	2.3000 % AWK 2.3 06/01/31	1'000	0	0	1'000 USD	77.77%	707'731.17	0.07	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CZ14	2.0000 % AMGN 2 01/15/32	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	0	2'000	0	2'000 USD	92.11%	1'676'474.51	0.16	a)
US036752AS28	3.6000 % ELV 3.6 03/15/51	0	3'000	1'000	2'000 USD	64.12%	1'167'107.27	0.11	a)
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833DT41	1.1250 % AAPL 1 1/8 05/11/25	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833DX52	0.5500 % AAPL 0.55 08/20/25	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	0	5'000	0	5'000 USD	85.01%	3'868'330.97	0.38	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	1'500	6'500	3'000	5'000 USD	93.38%	4'248'809.45	0.41	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	4'000	0	1'000	3'000 USD	75.29%	2'055'553.33	0.20	a)
US06051GJA85	4.0830 % BAC 4.083 03/20/51 MTN	4'000	1'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	2'500	2'500	0	5'000 USD	82.47%	3'752'549.63	0.36	a)
US06051GKK49	2.9720 % BAC 2.972 02/04/33 MTN	0	3'500	0	3'500 USD	76.60%	2'439'977.42	0.24	a)
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	0	8'000	4'000	4'000 USD	99.72%	3'630'074.71	0.35	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	600	4'400	0	5'000 USD	93.10%	4'236'422.22	0.41	a)
US09247XQA43	2.4000 % BLK 2.4 04/30/30	1'500	0	0	1'500 USD	82.06%	1'120'129.74	0.11	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	4'000	1'000	0	5'000 USD	79.30%	3'608'569.80	0.35	a)
US126408HU08	4.1000 % CSX 4.1 11/15/32	3'000	1'000	0	4'000 USD	87.49%	3'184'733.84	0.31	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	2'500	0	2'500 USD	92.21%	2'097'828.63	0.20	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	6'000	2'000	4'000 USD	84.72%	3'083'802.42	0.30	a)
US172967MD09	4.6500 % C 4.65 07/23/48	1'500	1'500	0	3'000 USD	76.87%	2'098'616.10	0.20	a)
US17325FBA57	5.8640 % C 5.864 09/29/25	0	4'300	0	4'300 USD	100.13%	3'918'496.75	0.38	a)
US17327CAN39	2.0140 % C 2.014 01/25/26	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US19416QEC06	2.1000 % CL 2.1 05/01/23 MTN	625	0	625	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US19416QEG10	3.2500 % CL 3 1/4 03/15/24 MTN	1'320	0	1'320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NCA72	3.1500 % CMCSA 3.15 02/15/28	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NCJ81	3.9000 % CMCSA 3.9 03/01/38	4'000	3'000	1'000	6'000 USD	77.54%	4'233'785.41	0.41	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36264FAL58	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/24/29	0	5'000	2'000	3'000 USD	88.38%	2'413'035.35	0.23	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	0	1'000	0	1'000 USD	98.97%	900'648.92	0.09	a)
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	0	4'900	0	4'900 USD	99.85%	4'452'730.80	0.43	a)
US437076BC57	3.7500 % HD 3 3/4 02/15/24	2'000	0	0	2'000 USD	99.47%	1'810'508.07	0.18	a)
US437076BT82	2.8000 % HD 2.8 09/14/27	750	2'250	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076BX94	4.5000 % HD 4 1/2 12/06/48	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US444859BG60	4.8000 % HUM 4.8 03/15/47	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CB48	4.9000 % INTC 4.9 08/05/52	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CC21	5.0500 % INTC 5.05 08/05/62	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200JH57	4.7000 % IBM 4.7 02/19/46	2'500	1'500	2'000	2'000 USD	79.56%	1'448'032.14	0.14	a)
US459200KC42	4.2500 % IBM 4 1/4 05/15/49	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KK67	2.8500 % IBM 2.85 05/15/40	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	0	6'000	3'000	3'000 USD	95.59%	2'609'882.63	0.25	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	3'000	0	0	3'000 USD	81.09%	2'213'752.80	0.22	a)
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457CG18	4.8750 % LLY 4 7/8 02/27/53	0	350	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661DV65	5.0000 % LOW 5 04/15/40	0	2'000	0	2'000 USD	83.41%	1'518'231.94	0.15	a)
US548661DX22	1.3000 % LOW 1.3 04/15/28	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'000	3'000	3'000	4'000 USD	69.24%	2'520'634.72	0.24	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	0	4'650	0	4'650 USD	91.47%	3'870'722.51	0.38	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	1'600	8'400	0	10'000 USD	76.34%	6'947'576.88	0.67	a)
US58933YAU91	2.9000 % MRK 2.9 03/07/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YAX31	3.4000 % MRK 3.4 03/07/29	700	2'300	0	3'000 USD	90.41%	2'468'330.74	0.24	a)
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59156RBD98	4.1250 % MET 4 1/8 08/13/42	0	3'000	2'000	1'000 USD	74.66%	679'439.49	0.07	a)
US594918BD56	3.7500 % MSFT 3 3/4 02/12/45	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918BS26	3.4500 % MSFT 3.45 08/08/36	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	2'500	1'500	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	3'000	6'000	6'000	3'000 USD	61.70%	1'684'421.41	0.16	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	0	5'000	0	5'000 USD	88.98%	4'048'819.96	0.39	a)
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US66989HAH12	4.4000 % NOVNVX 4.4 05/06/44	1'500	2'500	2'000	2'000 USD	81.62%	1'485'573.06	0.14	a)
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XAS45	3.6250 % ORCL 3 5/8 07/15/23	1'999	0	1'999	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XCN30	4.6500 % ORCL 4.65 05/06/30	0	2'450	2'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448CG16	2.7500 % PEP 2 3/4 03/01/23	1'090	0	1'090	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US717081FB45	1.7500 % PFE 1 3/4 08/18/31	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	1'400	0	0	1'400 USD	89.43%	1'139'386.31	0.11	a)
US74340XBN03	2.1250 % PLD 2 1/8 04/15/27	1'000	2'000	0	3'000 USD	88.68%	2'421'183.05	0.24	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109AZ71	0.7500 % O 0 3/4 03/15/26	0	3'000	0	3'000 USD	88.45%	2'414'952.27	0.23	a)
US756109BL76	2.8500 % O 2.85 12/15/32	0	5'000	0	5'000 USD	75.75%	3'446'901.47	0.33	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	900	3'100	0	4'000 USD	84.16%	3'063'772.29	0.30	a)
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACT07	3.4000 % TMUS 3.4 10/15/52	0	4'000	1'000	3'000 USD	59.22%	1'616'880.91	0.16	a)
US87264ACX19	5.8000 % TMUS 5.8 09/15/62	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US882508BC78	2.9000 % TXN 2.9 11/03/27	1'000	2'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US883556CL42	2.0000 % TMO 2 10/15/31	1'500	3'500	2'500	2'500 USD	75.41%	1'715'562.77	0.17	a)
US88579YBJ91	2.3750 % MMM 2 3/8 08/26/29	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FW39	2.9500 % UNP 2.95 03/10/52	0	5'000	3'500	1'500 USD	57.73%	788'078.13	0.08	a)
US907818FX12	2.8000 % UNP 2.8 02/14/32	3'000	2'000	0	5'000 USD	80.04%	3'641'954.39	0.35	a)
US907818GC65	4.9500 % UNP 4.95 09/09/52	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PDS83	2.8750 % UNH 2 7/8 08/15/29	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGC28	3.7000 % VZ 3.7 03/22/61	1'000	2'000	0	3'000 USD	61.12%	1'668'686.71	0.16	a)
US92343VVK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGN82	2.3550 % VZ 2.355 03/15/32	504	0	504	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAE21	4.1500 % V 4.15 12/14/35	0	4'000	2'000	2'000 USD	87.11%	1'585'416.65	0.15	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	3'000	2'000	1'000	4'000 USD	79.82%	2'905'624.71	0.28	a)
US92826CAL63	1.9000 % V 1.9 04/15/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAP77	0.7500 % V 0 3/4 08/15/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	1'000	4'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	600	0	0	600 USD	76.85%	419'623.75	0.04	a)
US94106LBD01	2.4000 % WM 2.4 05/15/23	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94973VBF31	5.1000 % ELV 5.1 01/15/44	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU01386AF57	5.7500 % ALCSW 5 3/4 12/06/52 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU74078CD32	4.0000 % NESNVX 4 09/24/48 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	75.56%	687'624.68	0.07	a)
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	90.34%	2'466'362.91	0.24	a)
USU75000BV72	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 REGS	1'200	1'500	0	2'700 USD	90.41%	2'221'594.04	0.22	a)
USU75000BW55	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	84.36%	3'838'590.90	0.37	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	2'550	3'450	4'000	2'000 USD	55.45%	1'009'172.65	0.10	a)
USU7514EAU48	2.8750 % SRENVX 2 7/8 12/06/22 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1028941117	1.8750 % MRK 1 7/8 10/15/26	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	100'000	200'000	0	300'000 JPY	98.08%	1'768'030.48	0.17	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	200'000	0	0	200'000 JPY	99.58%	1'196'798.43	0.12	a)
XS1879223565	2.9000 % T 2.9 12/04/26 GBP	1'100	900	1'000	1'000 GBP	91.74%	1'013'107.06	0.10	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	1'500	0	0	1'500 EUR	65.99%	952'177.58	0.09	a)
XS2055646918	0.7500 % ABBV 0 3/4 11/18/27	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2147995372	2.5000 % DHR 2 1/2 03/30/30	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	0	0	1'000 GBP	82.53%	911'323.72	0.09	a)
XS2404213485	0.3500 % PG 0.35 05/05/30	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2446386356	2.1030 % MS 2.103 05/08/26	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	0	2'400	0	2'400 EUR	97.52%	2'251'462.57	0.22	a)
XS2580271596	3.8750 % PLD 3 7/8 01/31/30 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2583742668	4.0000 % IBM 4 02/06/43	0	2'500	0	2'500 EUR	91.06%	2'189'705.91	0.21	a)
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	0	2'300	0	2'300 EUR	100.21%	2'217'010.94	0.22	a)
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	0	3'000	0	3'000 EUR	97.60%	2'816'492.55	0.27	a)
XS2625194811	4.6250 % PLD 4 5/8 05/23/33	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2644969698	5.1250 % O 5 1/8 07/06/34	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US							167'337'695.12	16.25	
AU3CB0243194	4.5000 % CAF 4 1/2 09/14/27 MTN	620	0	0	620 AUD	92.48%	330'367.48	0.03	a)
AU3CB0279818	0.8000 % ASIA 0.8 11/06/25 MTN	1'500	0	1'500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
CA298713AK48	4.5500 % EUROF 4.55 03/30/27 MPLE	500	0	0	500 CAD	98.96%	324'365.28	0.03	a)
EU000A1Z6630	0.6250 % EU 0 5/8 11/04/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A283867	0.1000 % EU 0.1 10/04/40 SURE	0	2'750	2'750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A284451	0.0000 % EU 0 11/04/25 SURE	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A284469	0.3000 % EU 0.3 11/04/50 SURE	0	3'250	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A287074	0.0000 % EU 0 06/02/28 SURE	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	1'000	14'000	1'000	14'000 EUR	82.06%	11'050'729.48	1.07	a)
EU000A3K4DG1	1.2500 % EU 1 1/4 02/04/43 NGEU	0	2'250	2'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	2'500	3'750	6'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DVO	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EA2	0.0000 % EUB 0 01/12/24 6M	0	7'500	100	7'400 EUR	99.26%	7'065'796.10	0.69	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	0	6'500	0	6'500 EUR	56.31%	3'520'608.47	0.34	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	0	3'500	0	3'500 EUR	85.53%	2'879'508.37	0.28	a)
JP500113AM39	0.2500 % CAF 0 1/4 03/19/24 18	0	400'000	0	400'000 JPY	99.93%	2'401'985.49	0.23	a)
US045167DR18	1.7500 % ASIA 1 3/4 08/14/26 GMTN	1'205	0	1'205	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167EG44	2.7500 % ASIA 2 3/4 01/19/28 GMTN	1'000	2'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167FC21	1.0000 % ASIA 1 04/14/26 GMTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167FG35	0.6250 % ASIA 0 5/8 10/08/24 GMTN	0	4'000	0	4'000 USD	95.59%	3'479'666.23	0.34	a)
US045167FS72	4.1250 % ASIA 4 1/8 09/27/24 GMTN	0	5'000	2'000	3'000 USD	98.74%	2'695'777.41	0.26	a)
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	1'800	0	0	1'800 USD	95.40%	1'562'750.35	0.15	a)
US219868CF16	2.2500 % CAF 2 1/4 02/08/27	0	5'000	0	5'000 USD	89.43%	4'069'446.56	0.40	a)
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	0	6'000	0	6'000 USD	97.38%	5'317'208.09	0.52	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	0	5'050	0	5'050 USD	100.51%	4'619'358.72	0.45	a)
US222213AS92	2.5000 % COE 2 1/2 02/27/24	3'000	2'500	1'500	4'000 USD	99.03%	3'605'035.67	0.35	a)
US298785HN98	2.0000 % EIB 2 12/15/22	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JF47	0.2500 % EIB 0 1/4 09/15/23	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JV96	3.7500 % EIB 3 3/4 02/14/33	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	0	2'283	0	2'283 USD	72.85%	1'513'480.82	0.15	a)
US4581X0CM87	2.1250 % IADB 2 1/8 01/15/25	1'250	0	0	1'250 USD	96.16%	1'093'904.86	0.11	a)
US4581X0DP00	0.2500 % IADB 0 1/4 11/15/23	3'000	0	0	3'000 USD	99.81%	2'724'880.81	0.26	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	5'000	1'000	4'000 USD	88.26%	3'212'994.57	0.31	a)
US459056HV23	1.5000 % IBRD 1 1/2 08/28/24 GDIF	0	6'000	0	6'000 USD	96.76%	5'283'277.07	0.51	a)
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	5'000	0	0	5'000 USD	78.10%	3'553'641.00	0.35	a)
US65562QBL86	2.2500 % NIB 2 1/4 05/21/24	0	2'000	0	2'000 USD	98.18%	1'786'955.98	0.17	a)
US65562QBN43	0.3750 % NIB 0 3/8 05/19/23	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	100'000	200'000	0	300'000 JPY	103.78%	1'870'918.15	0.18	a)
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0965896110	0.5000 % IADB 0 1/2 09/05/23 GMTN	0	50'000	50'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
XS1400224546	0.2500 % EUROF 0 1/4 04/25/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1524609531	5.5000 % EIB 5 1/2 01/23/23 EMTN	30'000	0	30'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
XS1622379698	3.0000 % EIB 3 05/24/24 EMTN	0	3'000	0	3'000 PLN	98.34%	637'121.39	0.06	a)
XS1958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	30'000	70'000	0	100'000 CNY	100.00%	12'395'411.85	1.20	a)
XS1963719585	3.0000 % EIB 3 11/25/29 EMTN	1'700	1'300	0	3'000 PLN	85.63%	554'763.37	0.05	a)
XS2191236715	4.2500 % EIB 4 1/4 06/19/24 EMTN	0	7'500	0	7'500 MXN	95.90%	362'580.77	0.04	a)
XS2288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	10'000	30'000	0	40'000 CNY	99.08%	4'912'303.09	0.48	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	500	0	0	500 EUR	91.41%	439'658.22	0.04	a)
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	9'000	0	0	9'000 CNY	99.85%	1'113'924.89	0.11	a)
XS2337107259	0.8750 % IDAWBG 0 7/8 04/28/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	90.02%	2'457'681.03	0.24	a)
XS2366200850	2.5500 % IBRD 2.55 07/19/23	25'000	0	25'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2384361684	0.2500 % ESM 0 1/4 09/08/23 REGS	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	0	100'000	0	100'000 CNY	99.55%	12'339'138.37	1.20	a)
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	25'000	0	0	25'000 CNY	101.46%	3'143'908.93	0.31	a)
XS2473766314	3.2500 % IBRD 3 1/4 04/28/25 EMTN	25'000	25'000	0	50'000 CNY	100.51%	6'229'189.33	0.61	a)
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27	2'400	5'000	1'400	6'000 EUR	93.81%	5'414'127.53	0.53	a)
XS2539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	0	30'000	0	30'000 CNY	99.86%	3'713'454.82	0.36	a)
XS2707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	0	75'000	0	75'000 CNY	98.02%	9'111'934.77	0.89	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS							136'787'855.32	13.29	
Derivative Finanzinstrumente							-16'854'030.06	-1.64	
Futures							0.00	0.00	
12/22	EURO-BUND FUTURE DEC22	-40	40	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	EURO-BOBL FUTURE DEC22	-345	345	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	US 5YR NOTE (CBT) DEC22	-125	125	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	450	450	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUXL 30Y BND MAR23	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 5YR NOTE (CBT) MAR23	0	125	125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	150	150	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	450	450	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUXL 30Y BND JUN23	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 5YR NOTE (CBT) JUN23	0	125	125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	75	75	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	375	375	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUXL 30Y BND SEP23	0	20	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	0	20	50	-30 EUR	0.00	0.00	0.00 a)	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	0	75	-75 EUR	0.00	0.00	0.00 a)	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	275	375	-100 EUR	0.00	0.00	0.00 a)	
Devisentermingeschäfte									
	AUD/CHF Verfall 15.11.2022		1'515'203	2'375'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 15.11.2022		10'000'000	1'463'824'505		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 15.11.2022		3'501'466	3'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 15.11.2022		6'675'000	49'527'357		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.11.2022		36'992'149	38'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 15.11.2022		16'075'734	16'325'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 18.11.2022		8'750'000'000	6'691'879		KRW/USD	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 18.11.2022		1'529'889	2'073'000'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 18.11.2022		5'077'455	6'677'000'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2023		1'050'000	1'055'040		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2023		3'275'000	3'041'587		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2023		147'881'376	1'075'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 17.02.2023		6'677'000'000	5'101'819		KRW/USD	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 17.02.2023		2'650'000'000	2'141'279		KRW/USD	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 17.02.2023		1'600'000'000	1'299'963		KRW/USD	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 17.02.2023		2'350'000'000	1'934'152		KRW/USD	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 17.02.2023		10'467'700	13'277'000'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 19.05.2023		690'092	750'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 19.05.2023		15'000'000'000	11'873'401		KRW/USD	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 19.05.2023		3'842'864	5'000'000'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 19.05.2023		7'479'432	10'000'000'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		16'153'784	2'000'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		2'250'000	1'524'728		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		884'763'567	5'500'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		1'750'000	1'048'114		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		14'250'000	12'794'006		USD/CHF	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		9'101'200	8'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		4'038'338	3'550'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		9'001'883	66'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.12.2022		257'640	1'250'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		25'609'986	3'800'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		19'414'395	143'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.12.2022		199'716	1'500'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 08.12.2022		623'134	12'600'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 08.12.2022		193'418	2'025'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.12.2022		139'126	675'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 08.12.2022		246'411	9'500'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		3'396'999	5'350'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		105'911'638	106'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 08.12.2022		288'933	3'025'000		CHF/NOK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		3'203'081	4'400'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		11'861'467	1'760'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		21'865'332	22'075'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		6'897'544	9'475'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.12.2022		174'976	250'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		371'342	650'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.12.2022		143'119	1'075'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		785'532	1'375'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.12.2022		395'675	4'375'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.12.2022		104'985	150'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 08.12.2022		510'979	19'700'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 08.12.2022		278'162	5'625'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		47'197'420	47'650'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.12.2022		775'609	8'575'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		49'187'427	49'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		1'571'509	2'475'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		350'000	398'540		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		150'000	148'693		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 08.12.2022		350'000	33'471		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		125'000	123'911		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		400'000	36'215		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		300'000	297'140		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		675'000	668'564		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		1'475'000	200'265		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		544'935	550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		297'237	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		739'343	750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		345'027	350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		850'000	116'298		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		3'445'106	3'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		1'360'839	1'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		825'364	121'850'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		400'370	350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		2'650'000	361'129		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		442'894	3'250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		457'565	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		182'024	250'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		319'852	500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		271'874	425'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		198'663	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		446'992	450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		197'913	200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		816'900	6'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		219'270	300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		1'010'250	150'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		599'060	4'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		79'688	125'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		127'500	200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		286'100	250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		400'540	350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		673'500	100'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		1'495'200	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		3'289'440	3'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		691'950	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		1'532'175	1'550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.12.2022		42'988	475'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		298'965	300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		98'591	100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		1'700'000	231'829		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		1'400'000	190'918		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		542'251	550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		497'603	500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		15'000'000	101'864		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		174'161	175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		200'000	201'580		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		100'000	100'790		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		375'000	372'234		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		200'000	198'525		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		250'000	246'662		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		125'000	123'331		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		75'000	48'122		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		50'000	32'081		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		16'000'000	108'486		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		75'000	55'199		CAD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		95'849	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		225'000	143'774		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		450'000	444'320		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		5'600'000	5'529'317		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		608'325	90'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		155'000'000	1'047'671		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		400'000	292'701		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		6'700'000	915'006		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 08.12.2022		175'000	23'265		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		2'450'000	2'422'136		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		375'000	424'465		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		350'000	31'869		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		225'000	221'754		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		100'000	98'558		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		2'975'000	2'933'758		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.12.2022		63'241	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		100'000	2'678		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		250'000	158'169		AUD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		391'116	350'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 08.12.2022		400'000	231'360		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		900'000	887'523		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		169'000'000	1'137'157		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		7'150'000	967'845		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		425'000	309'557		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		325'000	363'248		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		230'044	1'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		5'825'000	5'718'117		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		225'000	20'381		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		50'000	49'083		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		163'846	225'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		719'839	107'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 08.12.2022		675'000	390'420		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		750'000	20'088		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 08.12.2022		125'000	72'360		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 08.12.2022		550'000	114'989		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 08.12.2022		125'000	87'039		SGD/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 08.12.2022		138'054	5'250'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 08.12.2022		1'350'000	128'932		NOK/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 08.12.2022		131'517	2'650'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		1'390'000'000	9'499'691		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		3'300'000	2'388'015		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		2'950'000	3'326'818		GBP/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.12.2022		121'832	175'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		48'700'000	6'559'257		CNY/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.12.2022		125'676	950'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 08.12.2022		200'000	116'115		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		1'400'000	188'562		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		16'375'000	16'115'211		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 08.12.2022		145'622	1'525'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.12.2022		130'629	625'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.12.2022		4'450'000	220'906		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		6'775'000	178'250		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		36'600'000	35'319'183		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		58'000'000	396'390		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 08.12.2022		725'000	95'928		DKK/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.12.2022		186'546	2'050'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		2'125'000	1'353'976		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		3'075'000	279'865		SEK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		964'825	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		550'000	531'134		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		75'000	72'427		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		25'000	18'061		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		1'745'283	1'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		50'000	47'170		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		32'075'000	218'166		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		9'275'000	63'086		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		2'525'000	337'191		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		500'000	66'771		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		80'000	78'115		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.12.2022		213'419	300'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		72'062	125'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		166'801	150'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		50'000	4'514		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		675'000	636'841		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		25'000	662		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		50'000	35'552		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		650'000	86'979		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		50'000	55'393		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		300'000	293'117		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		35'400'000	238'479		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.12.2022		80'000	3'877		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		25'000	15'834		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		173'000'000	1'165'534		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		47'116	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.12.2022		50'000	2'426		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		20'000	1'798		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		75'000	1'978		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		30'000	19'071		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		40'000	44'584		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		300'000	282'300		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		650'000	86'191		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.12.2022		30'000	21'243		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.12.2022		125'000	122'269		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		1'284'136	1'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		1'472'969	217'075'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		689'312	700'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		246'562	1'850'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		26'655	200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		38'922	5'775'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		23'786	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		141'348	125'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		342'632	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		24'474	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		125'000	16'485		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.12.2022		2'450'000	323'106		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		1'156'053	1'225'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		94'372	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		22'743	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		295'044	300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		24'587	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		1'127'791	1'150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.12.2022		470'645	3'500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.12.2022		100'000	95'224		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		928'262	975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		25'000	2'233		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		100'000	2'706		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		31'125'000	212'537		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.12.2022		283'501	250'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		125'000	79'733		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.12.2022		13'000	8'292		AUD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		29'566	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.12.2022		25'000	1'227		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.12.2022		9'725'000	66'407		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		46'939	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		49'224	7'125'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.12.2022		1'243'872	1'325'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.12.2022		827'819	119'825'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		200'000	229'955		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.12.2022		15'000	17'247		GBP/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 08.12.2022		449'276	750'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.12.2022		175'000	8'546		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 08.12.2022		90'000	8'617		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.12.2022		95'000	8'579		SEK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		1'182'497	1'200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.12.2022		49'271	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 08.12.2022		325'000	8'789		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 09.12.2022		2'437'505	3'510'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 09.12.2022		1'173'614	1'690'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 09.12.2022		97'964	140'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		135'000'000	95'595		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 09.12.2022		157'565	220'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		147'000'000	105'282		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		450'000'000	321'429		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		1'300'000'000	928'571		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		23'400'000	16'674		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		6'225'000	4'416		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		113'850'000	82'418		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		14'100'000	10'207		KRW/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		12'000'000	8'689		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		3'166'150'000	2'258'264		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 09.12.2022		192'275'000	137'141		KRW/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 19.01.2023		989'736	10'975'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 19.01.2023		344'398	500'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 19.01.2023		421'889	4'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		20'002'659	149'050'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		1'355'430	10'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 19.01.2023		4'032'870	6'425'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		51'849'781	52'625'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.01.2023		2'002'751	291'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 19.01.2023		266'766	425'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 19.01.2023		7'196'637	10'500'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 19.01.2023		700'759	26'100'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 19.01.2023		331'193	2'500'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 19.01.2023		975'983	1'650'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.01.2023		10'384'922	9'075'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		7'455'437	7'975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		110'031'963	117'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 19.01.2023		37'589	1'400'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 19.01.2023		65'381	725'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 19.01.2023		479'776	700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.01.2023		29'534'206	4'292'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.01.2023		686'606	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 19.01.2023		744'474	15'875'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 19.01.2023		440'445	2'125'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		3'497'705	3'550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 19.01.2023		17'221	25'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 19.01.2023		59'156	100'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 19.01.2023		50'413	1'075'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		24'650	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		70'051	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		1'097'471	1'175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		348'067	2'625'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		1'039'316	1'125'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		115'480	125'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		29'973	225'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		575'000	567'822		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		25'000	24'688		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		275'000	308'244		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		1'150'000	1'060'812		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 19.01.2023		250'000	155'207		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		750'000	692'729		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		75'000	69'274		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		24'641	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 19.01.2023		350'000	46'520		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 19.01.2023		10'000'000	1'329'150		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		775'000	763'921		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 19.01.2023		61'238	8'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 19.01.2023		1'050'000	713'501		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 19.01.2023		50'000	33'976		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		46'391	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.01.2023		30'925'000	217'698		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		50'000	55'851		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		2'100'000	1'948'538		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		1'050'000	1'172'863		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 19.01.2023		250'000	22'233		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		725'000	669'339		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.01.2023		50'000	46'161		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		450'000	442'254		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.01.2023		2'975'000	20'657		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 19.01.2023		15'000	16'658		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 19.01.2023		200'000	136'162		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		25'000	24'658		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.01.2023		275'000	271'275		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		49'214	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 19.01.2023		46'000'000	324'623		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		1'237'300	1'250'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		138'283	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		2'028'147	2'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		103'322	750'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		92'873	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.01.2023		75'286	75'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 19.01.2023		150'000	88'866		NZD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/PLN Verfall 19.01.2023		125'000	26'746		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 19.01.2023		2'500'000	70'276		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 19.01.2023		900'000	79'988		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 19.01.2023		50'000	35'075		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 19.01.2023		1'240'812	9'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 19.01.2023		25'000	2'222		SEK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		3'124'923	3'375'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.01.2023		69'443	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 20.01.2023		2'198'822	3'100'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 20.01.2023		136'380	192'275'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 20.01.2023		225'000'000	168'479		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 20.01.2023		2'875'000'000	2'143'990		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 20.01.2023		192'275'000	143'386		KRW/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.03.2023		18'608	200'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.03.2023		26'216	125'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.03.2023		395'454	4'250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		20'555'238	151'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		3'818'803	3'850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.03.2023		605'740	21'825'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		646'820	575'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		6'670'170	9'750'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		3'766'633	5'875'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.03.2023		382'821	1'825'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		1'482'740	10'950'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		2'193'661	305'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.03.2023		520'039	750'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.03.2023		43'705	1'575'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.03.2023		931'086	19'300'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		52'942'502	53'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		109'848'391	120'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.03.2023		57'387	650'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		478'884	700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.03.2023		44'189	75'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.03.2023		34'669	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.03.2023		810'123	1'375'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.03.2023		316'863	2'375'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		272'459	425'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.03.2023		66'334	1'375'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.03.2023		805'619	9'125'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		30'696'864	4'268'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		9'027'355	8'025'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		7'959'473	8'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		45'384	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		510'056	800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 16.03.2023		100'000	2'789		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 16.03.2023		150'000	19'907		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 16.03.2023		75'000	44'081		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		33'729	250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 16.03.2023		1'650'000	46'010		THB/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.03.2023		478'114	1'775'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		24'670	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		1'175'000	56'453		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		300'000	27'741		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		50'000	2'402		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		333'915	2'475'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 16.03.2023		100'000	20'806		PLN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		1'179'971	1'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.03.2023		30'000	2'664		SEK/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		31'879	50'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		29'021	4'075'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		50'000	34'495		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.03.2023		650'000	57'723		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		10'000	6'967		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		1'275'000	61'633		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.03.2023		6'100'000	828'868		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		150'000	41'002		ILS/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		68'844	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.03.2023		14'890	25'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.03.2023		400'000	54'352		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 16.03.2023		125'000	26'393		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		275'000	25'819		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		125'000	80'878		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		75'000	3'625		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		50'000	34'833		SGD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/PLN Verfall 16.03.2023		45'000	9'502		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		170'000	8'218		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		2'270'000	110'060		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		250'000	23'103		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		25'000	17'433		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		180'000	125'516		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 16.03.2023		100'000	21'092		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		75'000	20'366		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		845'438	6'200'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		68'181	500'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		740'418	104'450'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		80'812	11'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		575'000	527'894		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		22'952	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		75'000	19'942		ILS/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		25'045	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 16.03.2023		100'000	21'148		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		200'000	18'529		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		675'000	676'116		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.03.2023		35'664	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		10'000	6'451		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		100'000	26'411		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 16.03.2023		40'000	27'778		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.03.2023		575'000	392'973		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.03.2023		20'000	13'669		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		772'526	775'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		300'000	193'541		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		200'000	18'276		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		60'000	2'892		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.03.2023		115'950'000	821'164		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		591'706	650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.03.2023		490'903	11'700'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 16.03.2023		8'380'000	59'348		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		68'274	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		700'000	33'737		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		75'000	19'987		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		40'841	300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.03.2023		100'000	8'720		SEK/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		15'882	25'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		481'148	700'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		198'900	200'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.03.2023		225'000	19'619		SEK/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.03.2023		15'652	75'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		333'524	525'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		27'790	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		17'184	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		626'235	4'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		528'005	475'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		900'000	43'024		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		150'000	13'440		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		50'000	2'390		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		625'000	573'922		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		100'000	110'816		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		175'000	111'586		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		1'700'000	1'560'279		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		50'000	45'891		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.03.2023		125'000	86'026		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		200'000	223'025		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		550'000	27'069		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		150'000	167'780		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 16.03.2023		200'000	18'142		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 16.03.2023		100'000	26'143		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		150'000	96'232		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.03.2023		10'000	6'415		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 16.03.2023		50'000	2'461		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 16.03.2023		575'000	51'046		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		1'075'000	992'043		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		125'000	115'354		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		400'000	370'996		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 16.03.2023		125'000	85'859		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		100'000	112'078		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 16.03.2023		10'000	11'208		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		825'000	815'051		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		1'242'238	1'325'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		93'754	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		40'357	300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		49'482	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		45'144	6'550'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		650'000	645'834		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.03.2023		50'000	49'680		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.03.2023		291'113	42'275'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		56'196	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.03.2023		69'123	100'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		987'593	1'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.03.2023		31'631	50'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		210'783	1'550'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		448'899	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		1'050'000	985'866		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		884'402	950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.03.2023		174'478	1'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		363'976	325'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.03.2023		49'742	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		162'941	175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.03.2023		55'998	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		2'969'165	4'000'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		208'491	280'875'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		280'000'000	208'178		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		10'500'000	7'807		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		261'250'000	193'272		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		18'760'000	13'879		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		16'645	22'350'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		22'375'000	17'212		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		136'975'000	103'377		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		11'625'000	8'774		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		16'829	23'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		39'254	54'725'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.03.2023		286'980	400'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		3'721'775'000	2'608'605		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.03.2023		317'690'000	222'670		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		109'607'672	120'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		9'402'064	10'375'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		51'814'396	53'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		4'439'840	4'550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		9'477'621	8'600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		798'986	725'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		30'004'953	4'402'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		2'574'760	377'775'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.05.2023		21'362'500	161'425'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.05.2023		1'832'867	13'850'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.05.2023		4'011'424	6'625'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.05.2023		333'024	550'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		6'735'905	10'150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		564'091	850'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.05.2023		237'050	2'750'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.05.2023		19'395	225'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.05.2023		679'453	7'825'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.05.2023		56'440	650'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.05.2023		380'471	2'900'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.05.2023		846'084	1'500'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 25.05.2023		70'507	125'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.05.2023		462'438	2'250'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.05.2023		35'967	175'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.05.2023		639'688	15'725'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.05.2023		54'918	1'350'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.05.2023		609'540	12'700'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.05.2023		51'595	1'075'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.05.2023		320'954	475'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.05.2023		307'361	1'225'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.05.2023		535'613	20'425'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.05.2023		45'891	1'750'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		644'657	700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		50'000	45'866		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		675'000	619'191		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.05.2023		4'000'000	27'901		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		725'961	800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		45'373	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.05.2023		150'000	101'254		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.05.2023		400'000	53'078		CNY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 25.05.2023		425'000	258'875	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.05.2023		450'000	12'081	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.05.2023		1'250'000	1'236'475	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		175'000	196'760	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.05.2023		75'000	9'965	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.05.2023		400'000	16'771	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.05.2023		8'200'000	1'088'829	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.05.2023		200'000	134'284	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		3'800'000	3'451'422	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.05.2023		71'400'000	491'246	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.05.2023		25'000	5'257	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.05.2023		50'000	4'346	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.05.2023		175'000	15'380	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.05.2023		200'000	9'968	MXN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		202'675	225'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		2'679'815	2'975'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		800'000	711'870	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		75'000	83'087	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		800'000	716'190	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		75'000	67'143	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.05.2023		37'875'000	253'444	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.05.2023		25'000	15'065	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.05.2023		125'000	138'690	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		763'744	775'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.05.2023		544'890	4'225'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		1'005'324	1'125'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		337'382	50'425'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.05.2023		2'658'512	3'809'225'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.05.2023		228'131	326'875'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.05.2023		435'000'000	291'555	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.05.2023		34'750'000	23'291	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.05.2023		3'374'225'000	2'306'801	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.05.2023		292'125'000	199'712	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.07.2023		25'000	27'907	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		806'011	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		484'745	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		656'194	7'775'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		4'495'122	4'650'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		838'502	1'500'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		9'428'841	10'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		311'428	525'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		54'865	650'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		631'825	12'900'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		53'877	1'100'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		69'875	125'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		2'474'913	380'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		526'117	20'325'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		563'482	850'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		28'917'409	4'440'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		51'790'577	53'575'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		636'318	15'700'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		18'444	225'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		373'371	2'875'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.07.2023		315'933	475'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		1'754'284	13'800'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		37'418	175'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		6'562'413	9'900'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		20'221'932	159'075'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		54'719	1'350'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		108'610'417	121'525'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		805'992	725'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		9'143'839	8'225'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		221'327	2'700'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		45'303	1'750'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		486'393	2'275'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		3'707'169	6'250'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.07.2023		50'000	48'378	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		100'000	89'863	USD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		246'577	2'975'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		2'755'323	2'850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 27.07.2023		50'000	2'027	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.07.2023		10'000	11'161	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		4'648'547	5'175'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		5'292	25'000	CHF/PLN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		7'125	275'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		8'109	200'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		4'026	50'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		6'493	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		306'909	275'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 27.07.2023		50'000	2'514	MXN/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		13'573	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		10'051	200'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		1'879'693	290'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		150'000	134'747	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		12'721	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		479'282	725'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		16'577	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 27.07.2023		75'000	1'950	THB/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		1'698'227	13'350'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		307'977	525'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		29'710	50'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		50'324	75'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		835'736	925'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		84'908	75'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		203'252	31'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		137'207	1'075'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		389'081	400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		22'308	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		2'342'372	2'625'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		37'435	6'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		573'998	92'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		3'044'731	3'125'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		170'505	175'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		538'245	475'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		1'064'774	1'575'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 27.07.2023		53'409	1'300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		2'024'179	16'375'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 27.07.2023		523'205	875'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		3'321'708	535'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 27.07.2023		144'862	2'775'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		3'491'570	3'575'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		67'102	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 27.07.2023		68'807	125'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 27.07.2023		14'637	175'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 27.07.2023		43'917	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 27.07.2023		55'874	9'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.07.2023		100'000	97'706	EUR/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 27.07.2023		33'161	50'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 27.07.2023		63'966	775'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 27.07.2023		29'515	225'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 27.07.2023		539'128	475'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		10'824'684	12'100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 27.07.2023		33'795	50'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 27.07.2023		39'686	1'550'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.07.2023		20'000	22'800	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		1'875'000	1'669'905	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 27.07.2023		100'000	114'008	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.07.2023		750'000	730'137	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 27.07.2023		225'000	150'451	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 27.07.2023		115'000'000	722'458	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		88'036	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		111'615	130'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		48'046	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		1'416'768	1'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		362'806	375'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		645'968	750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 27.07.2023		39'164	325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		64'583	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		72'264	75'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 27.07.2023		961'643	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		296'477	1'225'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		6'071	25'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 28.07.2023		18'158	75'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		197'372	290'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		2'314'011	3'400'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.07.2023		17'500'000	11'942	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		16'036	23'500'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 28.07.2023		171'616	250'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/KRW Verfall 28.07.2023		3'673'500'000	2'502'328		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 28.07.2023		272'500'000	185'623		KRW/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		66'643	1'325'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.09.2023		885'562	800'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		1'988'238	16'400'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		46'392	1'850'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 21.09.2023		19'222	225'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		10'372'664	12'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 21.09.2023		93'622	175'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 21.09.2023		56'168	1'425'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 21.09.2023		78'963	950'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		5'124'117	5'375'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		380'262	650'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		2'739'915	445'225'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		669'266	1'025'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 21.09.2023		42'769	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 21.09.2023		412'832	3'225'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		62'609'554	65'675'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		126'516'374	146'975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 21.09.2023		550'656	2'575'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		33'385'450	5'425'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 21.09.2023		341'044	525'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		566'102	22'575'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.09.2023		11'041'846	9'975'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		4'797'148	8'200'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 21.09.2023		694'711	17'625'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 21.09.2023		313'251	1'350'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		817'323	16'250'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 21.09.2023		982'882	11'825'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		8'243'393	12'625'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 21.09.2023		1'243'838	2'325'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 21.09.2023		254'133	2'975'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		24'246'800	200'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		5'000'000	30'758		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		175'000'000	1'078'840		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.09.2023		500'000	25'214		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		2'225'000	2'118'396		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		375'000	30'892		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		75'000	6'368		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		325'000	360'509		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		550'000	21'682		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		100'000	12'788		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		400'000	259'973		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		250'000	145'179		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 21.09.2023		50'000	26'645		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		6'025'000	5'171'318		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		50'000	10'686		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		100'000	85'831		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		700'000	17'627		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		6'500'000	784'700		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 21.09.2023		25'000	5'845		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		250'000	30'313		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		6'000'000	37'190		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		100'000'000	619'828		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		75'000	64'737		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 21.09.2023		80'000	51'992		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		75'000	71'611		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		50'000	10'768		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		50'000	6'398		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		175'000	14'397		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		125'000	72'760		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		50'000	4'269		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 21.09.2023		25'000	13'418		NZD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		86'235	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		350'000	8'863		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		175'000	194'214		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		28'132	4'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		23'826	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		250'000	10'002		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		55'000'000	336'372		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 21.09.2023		110'000	25'948		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		1'325'000	1'262'815		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		175'000	114'731		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		1'900'000	1'638'514		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/CNY Verfall 21.09.2023		7'525'000	912'572		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		50'000	43'578		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		4'150'000	3'616'941		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		275'000	22'388		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		140'000'000	863'407		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		50'000	10'642		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		225'000	249'028		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		1'600'000	1'527'802		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 21.09.2023		525'000	26'132		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		50'000	6'411		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 21.09.2023		50'000	26'476		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		500'000	12'641		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		350'000	228'368		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		150'000	85'597		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		75'000	6'378		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		400'000	15'725		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 21.09.2023		50'000	26'572		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.09.2023		300'000	24'720		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.09.2023		75'000	6'451		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		1'150'000	997'486		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		25'000	630		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		425'000	16'742		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 21.09.2023		225'000	129'051		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 21.09.2023		75'000	16'159		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.09.2023		150'000	143'905		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		525'000	13'232		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 21.09.2023		100'000	12'883		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		175'000'000	1'078'627		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		400'000	260'134		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.09.2023		25'000	16'258		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.09.2023		18'000'000	110'944		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		300'000	332'606		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		20'000	22'174		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.09.2023		225'000	251'520		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		42'115	350'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 21.09.2023		3'745	150'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		129'349	200'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		14'218	25'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		5'293'381	6'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.09.2023		334'083	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		153'114	175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 21.09.2023		4'047	50'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		20'798	400'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		47'856	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		227'490	400'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 21.09.2023		3'966	100'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		1'685'006	280'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		30'007	250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		108'322	18'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 21.09.2023		252'179	4'850'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 21.09.2023		882'191	7'350'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		1'674'943	1'750'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 21.09.2023		25'000	991		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 21.09.2023		25'000	627		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		200'230	295'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		2'477'423	3'650'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		94'793	140'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		1'015'638	1'500'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		11'500'000	7'680		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		150'000'000	100'168		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		190'000'000	127'748		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.09.2023		2'000'000	1'324		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.09.2023		33'103	50'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		92'981	175'000		CHF/NZD	485.48	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		74'610	925'000		CHF/SEK	-659.48	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		390'830	675'000		CHF/AUD	2'310.37	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		18'727	225'000		CHF/NOK	418.41	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		10'607'765	11'925'000		CHF/USD	-226'362.79	-0.02	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		854'864	775'000		CHF/GBP	351.78	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		43'903	1'775'000		CHF/THB	-1'057.15	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		647'206	975'000		CHF/CAD	8'943.10	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		89'181	1'725'000		CHF/MXN	2'576.32	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		120'866'248	135'875'000		CHF/USD	-2'579'207.10	-0.25	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		505'229	20'425'000		CHF/THB	-12'123.87	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		9'706'840	8'800'000	CHF/GBP		3'994.38	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		30'228'299	4'975'000'000	CHF/JPY		307'733.76	0.03	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		5'065'459	5'300'000	CHF/EUR		-27'688.80	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		857'002	10'625'000	CHF/SEK		-7'575.15	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		222'667	2'675'000	CHF/NOK		5'001.21	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		372'090	2'900'000	CHF/DKK		-1'334.67	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		41'154	200'000	CHF/PLN		-1'964.65	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		1'027'571	19'875'000	CHF/MXN		29'735.34	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		4'473'069	7'725'000	CHF/AUD		26'672.54	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		622'042	15'950'000	CHF/CZK		-778.83	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		483'560	2'350'000	CHF/PLN		-23'084.63	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		2'016'762	16'500'000	CHF/CNY		-28'015.63	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		53'622	1'375'000	CHF/CZK		-69.89	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		1'129'121	2'125'000	CHF/NZD		5'958.74	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		311'145	475'000	CHF/SGD		-4'062.98	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		286'781	1'225'000	CHF/ILS		11'571.26	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		2'643'077	435'000'000	CHF/JPY		26'907.38	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		58'133'311	60'825'000	CHF/EUR		-317'768.20	-0.03	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		23'223'320	190'000'000	CHF/CNY		-322'604.20	-0.03	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		7'484'356	11'275'000	CHF/CAD		103'418.86	0.01	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		25'000	23'900	EUR/CHF		124.19	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'200'000	269'355	CNY/CHF		3'282.55	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		70'000'000	425'575	JPY/CHF		-4'581.74	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		850'000	812'603	EUR/CHF		4'222.36	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		175'000	116'242	CAD/CHF		-1'682.29	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		2'175'000	1'935'693	USD/CHF		40'343.04	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		200'000	177'995	USD/CHF		3'709.71	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		5'500'000	33'438	JPY/CHF		-359.99	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		75'000	43'950	AUD/CHF		-780.72	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		2'525'000	2'302'303	USD/CHF		-8'242.56	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		12'000'000	73'792	JPY/CHF		-1'621.59	0.00	b)
	CHF/MXN Verfall 16.11.2023		100'000	5'135	MXN/CHF		-114.42	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		650'000	627'485	EUR/CHF		-2'848.70	0.00	b)
	CHF/CZK Verfall 16.11.2023		125'000	4'940	CZK/CHF		-58.44	0.00	b)
	CHF/THB Verfall 16.11.2023		125'000	3'116	THB/CHF		50.20	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		196'894	1'575'000	CHF/CNY		1'707.35	0.00	b)
	CHF/SEK Verfall 16.11.2023		50'000	4'170	SEK/CHF		-101.75	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		125'000	84'541	CAD/CHF		-2'710.90	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		125'000	138'403	GBP/CHF		-578.23	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		500'000	480'151	EUR/CHF		336.33	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'000'000	911'433	USD/CHF		-2'894.65	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		125'000	72'376	AUD/CHF		-427.59	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		45'000'000	277'457	JPY/CHF		-6'815.24	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		242'443	40'000'000	CHF/JPY		1'876.28	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		60'611	10'000'000	CHF/JPY		469.07	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		82'699	125'000	CHF/CAD		870.63	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		16'540	25'000	CHF/CAD		174.12	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		811'615	850'000	CHF/EUR		-5'210.19	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		95'484	100'000	CHF/EUR		-612.96	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		135'501	150'000	CHF/USD		-779.01	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		1'151'757	1'275'000	CHF/USD		-6'621.56	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		71'154	575'000	CHF/CNY		-104.09	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		110'378	100'000	CHF/GBP		117.84	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		175'000	156'768	USD/CHF		2'223.86	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		75'000	49'123	CAD/CHF		-26.69	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		575'000	543'323	EUR/CHF		9'231.22	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'000'000	244'838	CNY/CHF		3'014.11	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 16.11.2023		25'000	23'623	EUR/CHF		401.35	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		40'000'000	240'200	JPY/CHF		365.26	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 16.11.2023		125'000	136'087	GBP/CHF		1'736.06	0.00	b)
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		150'000	18'363	CNY/CHF		226.06	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 16.11.2023		1'825'000	1'635'120	USD/CHF		22'941.96	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 16.11.2023		6'000'000	36'039	JPY/CHF		45.80	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 16.11.2023		10'000	6'542	CAD/CHF		4.10	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		20'000	11'499	AUD/CHF		12.80	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		2'030	25'000	CHF/NOK		-4.38	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		5'388	25'000	CHF/PLN		-1.73	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		14'220	175'000	CHF/SEK		-20.54	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		215'439	325'000	CHF/SGD		-232.19	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		3'631'064	4'000'000	CHF/USD		-3'078.59	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		37'136	300'000	CHF/CNY		-42.32	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		48'010	50'000	CHF/EUR		-38.28	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'053	300'000	CHF/MXN		-8.30	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		27'528	25'000	CHF/GBP		-36.79	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		333'131	13'225'000		CHF/THB	-1'854.35	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		1'254	25'000		CHF/MXN	-0.70	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		28'968	1'150'000		CHF/THB	-161.24	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		1'195'683	9'650'000		CHF/CNY	-213.79	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		193'151	1'500'000		CHF/DKK	-0.85	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		114'563	175'000		CHF/CAD	4.58	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		12'692	325'000		CHF/CZK	1.34	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		2'738'893	2'850'000		CHF/EUR	113.47	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		827'024	750'000		CHF/GBP	76.63	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		25'000	14'392		AUD/CHF	-2.08	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		660'303	110'000'000		CHF/JPY	-1'251.79	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		2'668'446	4'000'000'000		CHF/KRW	-24'600.81	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		233'489	350'000'000		CHF/KRW	-2'152.57	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		466'667	700'000'000		CHF/KRW	-4'616.21	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		90'000'000	60'932		KRW/CHF	-338.01	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		46'962	70'000'000		CHF/KRW	-166.05	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		10'000'000	6'721		KRW/CHF	11.62	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		57'088	85'000'000		CHF/KRW	-139.72	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-3'006'719.80	-0.29	

Swaps

							-13'847'310.26	-1.35		
09/27	IRS FIX LEG 2.41502% P.A. EUR	17'000	0	7'000	10'000	EUR	96.72%	9'303'290.43	0.90	b)
09/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-17'000	7'000	0	-10'000	EUR	100.00	-9'619'267.10	-0.93	b)
10/27	IRS FIX LEG 2.95% P.A. EUR	25'000	0	0	25'000	EUR	98.72%	23'739'202.42	2.31	b)
10/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-25'000	0	0	-25'000	EUR	100.00	-24'048'167.75	-2.34	b)
01/28	IRS FIX LEG 2.8012% P.A. EUR	0	15'000	0	15'000	EUR	99.28%	14'325'169.98	1.39	b)
01/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURO06M	0	0	15'000	-15'000	EUR	100.00	-14'428'900.65	-1.40	b)
02/28	IRS FIX LEG 0.4725% P.A. JPY	0	3'000'000	0	3'000'000	JPY	99.80%	17'991'726.38	1.75	b)
02/28	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	0	0	3'000'000	-3'000'000	JPY	100.00	-18'027'330.00	-1.75	b)
07/28	IRS FIX LEG 0.2463% P.A. JPY	0	1'000'000	0	1'000'000	JPY	98.22%	5'901'995.69	0.57	b)
07/28	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'000'000	-1'000'000	JPY	100.00	-6'009'110.00	-0.58	b)
07/28	IRS FIX LEG 2.4355% P.A. CNY	0	150'000	0	150'000	CNY	99.96%	18'584'485.44	1.81	b)
07/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	0	0	150'000	-150'000	CNY	100.00	-18'592'560.00	-1.81	b)
09/28	IRS FIX LEG 0.289% P.A. JPY	300'000	0	0	300'000	JPY	98.20%	1'770'270.83	0.17	b)
09/28	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-300'000	0	0	-300'000	JPY	100.00	-1'802'733.00	-0.18	b)
05/30	IRS FIX LEG 3.10609% P.A. USD	0	15'000	0	15'000	USD	91.15%	12'442'481.44	1.21	b)
05/30	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	15'000	-15'000	USD	100.00	-13'650'750.00	-1.33	b)
01/32	IRS FIX LEG 0.0951% P.A. JPY	1'000'000	0	1'000'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
01/32	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-1'000'000	1'000'000	0	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
01/33	IRS FIX LEG 0.79253% P.A. JPY	0	1'000'000	0	1'000'000	JPY	97.94%	5'885'618.10	0.57	b)
01/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'000'000	-1'000'000	JPY	100.00	-6'009'110.00	-0.58	b)
02/33	IRS FIX LEG 0.8555% P.A. JPY	0	1'250'000	0	1'250'000	JPY	98.43%	7'393'454.51	0.72	b)
02/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'250'000	-1'250'000	JPY	100.00	-7'511'387.50	-0.73	b)
06/33	IRS FIX LEG 0.56875% P.A. JPY	0	1'500'000	1'500'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
06/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	1'500'000	1'500'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
07/33	IRS FIX LEG 3.55612% P.A. USD	0	15'000	0	15'000	USD	92.06%	12'566'990.07	1.22	b)
07/33	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	15'000	-15'000	USD	100.00	-13'650'750.00	-1.33	b)
09/33	IRS FIX LEG 0.8395% P.A. JPY	0	800'000	0	800'000	JPY	97.26%	4'675'670.85	0.45	b)
09/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	800'000	-800'000	JPY	100.00	-4'807'288.00	-0.47	b)
11/33	IRS FIX LEG 0.12575% P.A. JPY	700'000	0	0	700'000	JPY	90.15%	3'792'233.65	0.37	b)
11/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-700'000	0	0	-700'000	JPY	100.00	-4'206'377.00	-0.41	b)
01/38	IRS FIX LEG 1.0551% P.A. JPY	0	1'000'000	1'000'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
01/38	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	0	1'000'000	1'000'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
09/38	IRS FIX LEG 0.689% P.A. JPY	300'000	0	300'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
09/38	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-300'000	300'000	0	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
04/40	IRS FIX LEG 0.0875% P.A. JPY	300'000	0	300'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
04/40	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-300'000	300'000	0	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
11/41	IRS FIX LEG 0.31625% P.A. JPY	300'000	0	300'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	
11/41	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-300'000	300'000	0	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
07/42	IRS FIX LEG 2.819% P.A. USD	4'000	0	0	4'000	USD	78.09%	2'842'744.41	0.28	b)
07/42	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	-4'000	0	0	-4'000	USD	100.00	-3'640'200.00	-0.35	b)
11/42	IRS FIX LEG 1.05188% P.A. JPY	0	300'000	300'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
11/42	IRS FLOATING LEG - JPY OIS TONAR	0	300'000	300'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
01/43	IRS FIX LEG 1.3375% P.A. JPY	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	96.05%	5'771'771.19	0.56	b)
01/43	IRS FLOATING LEG - JPY OIS TONAR	0	0	1'000'000	-1'000'000 JPY	100.00	-6'009'110.00	-0.58	b)
02/43	IRS FIX LEG 1.26% P.A. JPY	0	1'500'000	0	1'500'000 JPY	94.55%	8'522'666.96	0.83	b)
02/43	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	0	0	1'500'000	-1'500'000 JPY	100.00	-9'013'665.00	-0.88	b)
03/43	IRS FIX LEG 3.4366% P.A. USD	0	7'500	0	7'500 USD	85.21%	5'815'641.38	0.56	b)
03/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	7'500	-7'500 USD	100.00	-6'825'375.00	-0.66	b)
09/43	IRS FIX LEG 4.1578% P.A. USD	0	17'500	0	17'500 USD	95.47%	15'204'352.44	1.48	b)
09/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	17'500	-17'500 USD	100.00	-15'925'875.00	-1.55	b)
10/43	IRS FIX LEG 4.618% P.A. USD	0	0	17'500	-17'500 USD	101.60%	-16'180'132.71	-1.57	b)
10/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	17'500	0	17'500 USD	100.00	15'925'875.00	1.55	b)
10/48	IRS FIX LEG 0.911% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	82.93%	1'245'808.60	0.12	b)
10/48	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'502'277.50	-0.15	b)
02/50	IRS FIX LEG 1.7007% P.A. USD	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
02/50	IRS FLOATING LEG - LIBOR 3M USD	-2'000	2'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/50	IRS FIX LEG 0.2445% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	67.82%	1'018'799.70	0.10	b)
02/50	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'502'277.50	-0.15	b)
11/50	IRS FIX LEG 1.2933% P.A. USD	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
11/50	IRS FLOATING LEG - LIBOR 3M USD	-6'000	6'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/51	IRS FIX LEG 0.36451% P.A. JPY	350'000	0	0	350'000 JPY	68.96%	1'450'329.26	0.14	b)
07/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONAR	-350'000	0	0	-350'000 JPY	100.00	-2'103'188.50	-0.20	b)
11/51	IRS FIX LEG 0.47% P.A. JPY	200'000	0	0	200'000 JPY	70.97%	852'884.05	0.08	b)
11/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-200'000	0	0	-200'000 JPY	100.00	-1'201'822.00	-0.12	b)
01/52	IRS FIX LEG 1.656% P.A. USD	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
01/52	IRS FLOATING LEG - USD - USD-SOFR-COMPOUND	-6'000	6'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/53	IRS FIX LEG 1.31% P.A. JPY	0	500'000	0	500'000 JPY	90.55%	2'720'774.54	0.26	b)
02/53	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	0	0	500'000	-500'000 JPY	100.00	-3'004'555.00	-0.29	b)
04/53	IRS FIX LEG 2.967% P.A. USD	0	4'000	0	4'000 USD	76.78%	2'795'096.48	0.27	b)
04/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	4'000	-4'000 USD	100.00	-3'640'200.00	-0.35	b)
06/53	IRS FIX LEG 3.21718% P.A. USD	0	7'500	0	7'500 USD	81.31%	5'549'723.47	0.54	b)
06/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	7'500	-7'500 USD	100.00	-6'825'375.00	-0.66	b)
08/53	IRS FIX LEG 3.56724% P.A. USD	0	16'000	0	16'000 USD	87.54%	12'746'153.60	1.24	b)
08/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	16'000	-16'000 USD	100.00	-14'560'800.00	-1.41	b)
09/53	IRS FIX LEG 3.9383% P.A. USD	0	7'000	0	7'000 USD	93.97%	5'986'413.08	0.58	b)
09/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	7'000	-7'000 USD	100.00	-6'370'350.00	-0.62	b)
11/53	IRS FIX LEG 4.29579% P.A. USD	0	5'500	0	5'500 USD	100.00%	5'005'275.00	0.49	b)
11/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	0	5'500	-5'500 USD	100.00	-5'005'275.00	-0.49	b)

	Kurswert CHF	in % 7)
Vermögensaufstellung		
Bankguthaben auf Sicht	115'492'262.59	11.22
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	923'722'696.96	89.72
Derivative Finanzinstrumente	-16'854'030.06	-1.64
Sonstige Vermögenswerte	7'147'517.71	0.69
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'029'508'447.20	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-23'745'397.69	
Andere Verbindlichkeiten	-28'056.74	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'005'734'992.77	

	Kurswert CHF	in % 7)
Bewertungskategorien		
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);	923'722'696.96	89.72
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-16'854'030.06	-1.64
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts		
OTC COLLATERAL IV-BFNINT JPY ZKB	2'293'053'000 JPY	13'779'207.71

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57619816
CAD	1 = CHF	0.65553755
CNY	1 = CHF	0.12395040
CZK	100 = CHF	3.91352000
DKK	100 = CHF	12.88776200
EUR	1 = CHF	0.96192671
GBP	1 = CHF	1.10430017
HUF	100 = CHF	0.25122000
ILS	1 = CHF	0.22495087
JPY	100 = CHF	0.60091100
KRW	1 = CHF	0.00067384
MXN	1 = CHF	0.05040990
NOK	100 = CHF	8.14603000
NZD	1 = CHF	0.52933058
PLN	1 = CHF	0.21595871
SEK	100 = CHF	8.14533700
SGD	1 = CHF	0.66424583
THB	100 = CHF	2.53196100
USD	1 = CHF	0.91005000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	227'981'466.99	22.668
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	336'953'187.28	33.503

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
GTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
Swiss Red Cross	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, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %		PAF p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max
DT CHF	0.500	0.750	0.400		0.100			2.000
GT CHF	0.400	0.650	0.300		0.100			2.000
GTH1 CHF	0.400	0.700	0.300		0.100			2.000
MT CHF	-	-	-		-			2.000
NT CHF	-	-	-		-			2.000
NTH1 CHF	-	-	-		-			2.000
Swiss Red Cross	0.700	0.900	0.500		0.200			2.000

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

Bloomberg Global Aggregate TR Index Unhedged CHF

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: 21.02.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
Swiss Red Cross	Ja	CHF	0.35000	0.12250	0.22750

CHF 0.35000 pro Anteil gehen als Spende an das Schweizerische Rote Kreuz.

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	0.88192	0.30867	0.57325
GT CHF	Ja	CHF	1.040	0.364	0.676
GTH1 CHF	Ja	CHF	0.99784	0.34924	0.64860
MT CHF	Ja	CHF	1.294	0.452	0.842
NT CHF	Ja	CHF	14.670	5.134	9.536
NTH1 CHF	Ja	CHF	1.383	0.484	0.899

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 14) Neue Klassenbezeichnung per 14.09.2022: von GTH CHF Klasse in GTH1 CHF Klasse und von NTH CHF Klasse in NTH1 CHF Klasse.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 19 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen 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 Quoten am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund I

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

Zurzeit mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde die Anlagepolitik und die Risikoverteilung soweit möglich dem Musterfondsvertrag der Asset Management Association Switzerland angepasst und Bestimmungen in diesen Bereichen standardisiert, harmonisiert und vereinfacht. Mit dieser Fondsvertragsänderung waren keine Umschichtungen von Anlagen in den Teilvermögen und keine Änderung der effektiven Anlagepolitik der Teilvermögen verbunden.

Die Teilvermögen des Umbrella-Fonds werden in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv verwaltet. Diesem Sachverhalt trägt die Bestimmung von § 16 Ziff. 4 Rechnung. Darin ist festgehalten, dass wenn sich ein Teilvermögen an einem Referenzindex (Benchmark) orientiert, der Anteil desselben Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens die Limiten von § 16 Ziff. 3 übersteigen darf. Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde dem Umstand, dass dies für sämtliche Effekten und Geldmarktinstrumente Anwendung finden soll, nicht genügend Rechnung getragen. Entsprechend soll mit dieser Fondsvertragsüberarbeitung diese Bestimmung für sämtliche Effekten oder Geldmarktinstrumente desselben Emittenten gelten und somit auch bei den Obligationen-Teilvermögen zur Anwendung kommen.

Pfandbriefe der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale weisen gemäss Referenzindex der Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF einen Anteil von über 10% am Referenzindex auf. Bei beiden Teilvermögen beträgt der Anteil in Pfandbriefen der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale ebenfalls über 10% des Vermögens der Teilvermögen. Mit der Erweiterung in § 16 Ziff. 4 von ehemals Beteiligungswertpapieren und -wertrechten auf neu Effekten oder Geldmarktinstrumente wird fortan diese Bestimmung die Emittentenbegrenzung definieren. Aktuell kommt die Gesamtbeschränkung von § 16 Ziff. 7 zur Anwendung. Diese beinhaltet, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen desselben Emittenten bzw. Schuldner insgesamt 20% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen darf.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebene Änderung des Fondsvertrags 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

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

Zürich, 10. November 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Investment Fund I

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Die Anlagepolitik der nachstehend aufgeführten Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 5 B Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 C Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 D Bst. d, § 8 Ziff. 5 E Bst. d, § 8 Ziff. 5 F Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 G Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 H Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 I Bst. d, § 8 Ziff. 5 J Bst. d und § 8 Ziff. 5 K Bst. a und c des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 andere Währung als den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 C Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind,

wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (§ 8 Ziff. 5 C Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 D Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 E Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 und mit Bonität Investment Grade (Mindestrating BBB- oder gleichwertig), zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 I Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible 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 Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 J Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. c).

* * *

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

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

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

Zürich, 22. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich