

AKB OBLIGATIONEN CHF ESG FOKUS

Jahresbericht per 30.11.2023

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

Klasse	Valor	Währung
A	122341450	CHF
Q	23451103	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 22.03.2024

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 22. März 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

AKB Portfoliofonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ AKB Einkommen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Rendite CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Rendite EUR ESG Fokus
- ▶ AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Wachstum CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus
- ▶ AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus
- ▶ AKB Obligationen CHF ESG Fokus
- ▶ AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus¹

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. November 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben.

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

Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	14
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
7	Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	16
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	16
12	Fussnoten	16
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17
14	Pflichtpublikationen	19

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

Anlageentscheide Aargauische Kantonalbank, Postfach, 5001 Aarau
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Aargauische Kantonalbank, Postfach, 5001 Aarau

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.12.2022	01.12.2021	01.12.2020	01.12.2019
	bis	30.11.2023	30.11.2022	30.11.2021	30.11.2020
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		514'601'834.17	462'894'749.52	422'837'414.37	406'797'928.62
Klasse A					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		16'742'874.50			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		163'611.165			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		102.33			
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %			
Klasse Q					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		497'858'959.67	462'894'749.52	422'837'414.37	406'797'928.62
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'122'513.000	4'914'555.000	4'001'587.000	3'829'464.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		97.19	94.19	105.67	106.23
Thesaurierung je Anteil		0.59	0.32	0.25	0.33
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.15 %	0.15 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse A (Lancierung 02.06.2023)	2.59 %	-	-	-
Klasse Q	3.31 %	-12.32 %	-1.54 %	0.77 %
Benchmark	3.25 %	-12.10 %	-1.82 %	0.9 %
Tracking Error 33)	0.50 %	0.70 %	0.36 %	1.39 %

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 A (Lancierung 02.06.2023)	-0.66 %
Klasse Q	0.06 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.11.2023	30.11.2022
Bankguthaben auf Sicht	2'573'534.77	1'505'747.51
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	509'586'490.00	459'749'735.63
Sonstige Vermögenswerte	2'507'959.34	1'695'542.62
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'667'984.11	462'951'025.76
Andere Verbindlichkeiten	-66'149.94	-56'276.24
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'601'834.17	462'894'749.52

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	Lancierung 02.06.2023 30.11.2023
Ausgegebene Anteile		163'905.854
Zurückgenommene Anteile		-294.689
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		163'611.165

Klasse Q	von bis	01.12.2022 30.11.2023	01.12.2021 30.11.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'914'555.000	4'001'587.000
Ausgegebene Anteile		596'722.000	1'117'944.000
Zurückgenommene Anteile		-388'764.000	-204'976.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'122'513.000	4'914'555.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.12.2022 30.11.2023	01.12.2021 30.11.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		462'894'749.52	422'837'414.37
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-572'482.73	-370'990.13
Saldo aus dem Anteilverkehr		35'808'464.51	88'990'969.38
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		16'471'102.87	-48'562'644.10
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		514'601'834.17	462'894'749.52

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.12.2022 30.11.2023	01.12.2021 30.11.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		11'109.65	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-23'634.60
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'711'530.38	2'168'832.65
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		199'142.41	136'853.18
Total Ertrag		3'921'782.44	2'282'051.23
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-160.80
Reglementarische Vergütungen		-729'690.70	-655'931.66
Sonstige Aufwendungen		0.00	-64.30
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-133'944.64	-33'633.95
Total Aufwand		-863'635.34	-689'790.71
Nettoertrag / Verlust		3'058'147.10	1'592'260.52
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'302'646.39	-4'426'807.84
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		237'503.28	299'755.95
Realisierter Erfolg		-2'006'996.01	-2'534'791.37
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		18'478'098.88	-46'027'852.73
Gesamterfolg		16'471'102.87	-48'562'644.10

Verwendung des Erfolges

Klasse A	30.11.2023	
Nettoertrag	31'344.34	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	31'344.34	
Vortrag auf neue Rechnung	31'344.34	
Total	31'344.34	

Klasse Q	30.11.2023	30.11.2022
Nettoertrag	3'026'802.76	1'592'260.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'026'802.76	1'592'260.52
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'059'380.97	557'291.18
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'967'421.79	1'034'969.34
Total	3'026'802.76	1'592'260.52

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							509'586'490.00	99.01	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							509'586'490.00	99.01	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	1'500	0	0	1'500 CHF	109.00%	1'635'000.00	0.32	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	1'750	0	250	1'500 CHF	103.70%	1'555'500.00	0.30	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'500	0	0	1'500 CHF	101.20%	1'518'000.00	0.29	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	5'000	0	0	5'000 CHF	110.08%	5'504'000.00	1.07	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	5'000	0	0	5'000 CHF	105.21%	5'260'500.00	1.02	a)
CH0136594337	1.6250 % EBN 1 5/8 10/03/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	0	1'500	0	1'500 CHF	99.60%	1'494'000.00	0.29	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	100.70%	2'014'000.00	0.39	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	2'500	2'500	0	5'000 CHF	100.38%	5'019'000.00	0.98	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	0	3'000	0	3'000 CHF	99.70%	2'991'000.00	0.58	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	0	7'500	2'500	5'000 CHF	95.36%	4'768'000.00	0.93	a)
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'025	0	0	1'025 CHF	100.00%	1'025'000.00	0.20	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILJ 1 1/4 09/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'000	0	0	1'000 CHF	99.15%	991'500.00	0.19	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	3'000	0	0	3'000 CHF	98.75%	2'962'500.00	0.58	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'000	0	0	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.19	a)
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	5'000	0	1'500	3'500 CHF	98.61%	3'451'350.00	0.67	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	2'000	0	0	2'000 CHF	93.57%	1'871'400.00	0.36	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	2'000	0	0	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.38	a)
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	2'500	0	0	2'500 CHF	91.20%	2'280'000.00	0.44	a)
CH0268988158	0.8750 % PARJNT 0 7/8 04/24/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.20%	1'443'000.00	0.28	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	2'000	1'500	0	3'500 CHF	98.41%	3'444'350.00	0.67	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'750	0	250	1'500 CHF	97.89%	1'468'350.00	0.29	a)
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	1'000	0	0	1'000 CHF	94.02%	940'200.00	0.18	a)
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	1'000	0	0	1'000 CHF	91.30%	913'000.00	0.18	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.19	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.19	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	2'000	0	0	2'000 CHF	98.19%	1'963'800.00	0.38	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	1'000	0	0	1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.19	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000 CHF	100.50%	1'005'000.00	0.20	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	1'000	0	0	1'000 CHF	89.63%	896'300.00	0.17	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	1'000	0	0	1'000 CHF	87.97%	879'700.00	0.17	a)
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'000	0	0	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.19	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	2'500	0	0	2'500 CHF	94.82%	2'370'500.00	0.46	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	1'000	0	0	1'000 CHF	83.45%	834'500.00	0.16	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'000	0	0	1'000 CHF	93.85%	938'500.00	0.18	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	2'000	0	0	2'000 CHF	77.46%	1'549'200.00	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	1'000	0	0	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.19	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	0	2'500	0	2'500 CHF	94.70%	2'367'500.00	0.46	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	1'000	4'000	0	5'000 CHF	93.33%	4'666'500.00	0.91	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	2'000	0	0	2'000 CHF	92.02%	1'840'400.00	0.36	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	1'500	0	0	1'500 CHF	95.10%	1'426'500.00	0.28	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'500	1'000	0	2'500 CHF	93.60%	2'340'000.00	0.45	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.19	a)
CH0357483160	2.0000 % KWLLI 2 12/11/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	0	2'000	0	2'000 CHF	95.91%	1'918'200.00	0.37	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'500	1'500	1'500	1'500 CHF	90.45%	1'356'750.00	0.26	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501508	0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.00%	940'000.00	0.18	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	5'000	0	0	5'000 CHF	95.20%	4'760'000.00	0.92	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMN VX 0 3/4 11/24/33	1'500	0	0	1'500 CHF	91.65%	1'374'750.00	0.27	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	5'000	0	0	5'000 CHF	95.34%	4'767'000.00	0.93	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	955	545	0	1'500 CHF	92.10%	1'381'500.00	0.27	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	0	0	1'000 CHF	95.10%	951'000.00	0.18	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	2'000	0	0	2'000 CHF	95.92%	1'918'400.00	0.37	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	0	1'500	0	1'500 CHF	98.20%	1'473'000.00	0.29	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	2'000	0	0	2'000 CHF	92.77%	1'855'400.00	0.36	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	93.45%	1'401'750.00	0.27	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	1'000	1'500	0	2'500 CHF	88.85%	2'221'250.00	0.43	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	1'000	0	0	1'000 CHF	96.55%	965'500.00	0.19	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.19	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	4'000	0	0	4'000 CHF	95.81%	3'832'400.00	0.74	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	1'000	0	0	1'000 CHF	96.50%	965'000.00	0.19	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	3'000	0	0	3'000 CHF	95.05%	2'851'500.00	0.55	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'000	0	0	2'000 CHF	95.55%	1'911'000.00	0.37	a)
CH0398633807	0.7000 % PPSNSW 0.7 02/08/27 0	1'000	0	0	1'000 CHF	96.55%	965'500.00	0.19	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	1'000	0	0	1'000 CHF	89.70%	897'000.00	0.17	a)
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.30%	953'000.00	0.19	a)
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	500	500	0	1'000 CHF	91.00%	910'000.00	0.18	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.19	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	0	1'500	0	1'500 CHF	94.45%	1'416'750.00	0.28	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.80%	968'000.00	0.19	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	1'500	0	0	1'500 CHF	98.20%	1'473'000.00	0.29	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	1'000	0	0	1'000 CHF	94.05%	940'500.00	0.18	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.20%	952'000.00	0.18	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	2'000	0	0	2'000 CHF	93.54%	1'870'800.00	0.36	a)
CH0419040982	0.5000 % SCMN VX 0 1/2 03/15/29	1'500	0	500	1'000 CHF	94.90%	949'000.00	0.18	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.19	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'000	0	1'500	1'500 CHF	92.45%	1'386'750.00	0.27	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	2'000	0	0	2'000 CHF	90.25%	1'805'000.00	0.35	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	2'000	0	0	2'000 CHF	97.47%	1'949'400.00	0.38	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	4'000	0	0	4'000 CHF	93.02%	3'720'800.00	0.72	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	4'000	0	0	4'000 CHF	89.48%	3'579'200.00	0.70	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	1'000	0	0	1'000 CHF	92.35%	923'500.00	0.18	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	1'000	0	0	1'000 CHF	83.60%	836'000.00	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	1'250	0	0	1'250 CHF	90.55%	1'131'875.00	0.22	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'000	0	0	1'000 CHF	90.50%	905'000.00	0.18	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	500	0	0	500 CHF	62.10%	310'500.00	0.06	a)
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	1'000	0	0	1'000 CHF	89.60%	896'000.00	0.17	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	1'500	0	0	1'500 CHF	97.00%	1'455'000.00	0.28	a)
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0420465947	0.7500 % AMPAU 0 3/4 12/19/22 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	2'000	0	0	2'000 CHF	97.48%	1'949'600.00	0.38	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	2'000	0	0	2'000 CHF	95.30%	1'906'000.00	0.37	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	2'000	0	0	2'000 CHF	95.35%	1'907'000.00	0.37	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.65%	986'500.00	0.19	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	1'000	0	0	1'000 CHF	91.75%	917'500.00	0.18	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	1'000	0	0	1'000 CHF	93.35%	933'500.00	0.18	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.19	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	5'000	0	0	5'000 CHF	96.37%	4'818'500.00	0.94	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	3'000	0	1'500	1'500 CHF	97.20%	1'458'000.00	0.28	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	1'000	0	0	1'000 CHF	98.38%	983'800.00	0.19	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	1'000	0	0	1'000 CHF	92.55%	925'500.00	0.18	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.28%	982'800.00	0.19	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.60%	946'000.00	0.18	a)
CH0457206800	0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.10%	951'000.00	0.18	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'000	0	0	1'000 CHF	96.75%	967'500.00	0.19	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'000	0	0	1'000 CHF	93.80%	938'000.00	0.18	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'000	0	1'000	1'000 CHF	93.95%	939'500.00	0.18	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.15%	931'500.00	0.18	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'000	0	0	1'000 CHF	84.35%	843'500.00	0.16	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	80.25%	1'605'000.00	0.31	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	1'000	0	0	1'000 CHF	82.35%	823'500.00	0.16	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	1'000	0	0	1'000 CHF	89.50%	895'000.00	0.17	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.20%	922'000.00	0.18	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'025	0	1'025	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	3'000	0	0	3'000 CHF	92.55%	2'776'500.00	0.54	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.80%	978'000.00	0.19	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	91.85%	1'377'750.00	0.27	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691408	0.8000 % AMPAU 0.8 07/18/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	91.35%	2'283'750.00	0.44	a)
CH0474178420	0.1250 % RAIFFS 0 1/8 05/07/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	1'500	0	500	1'000 CHF	96.05%	960'500.00	0.19	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.60%	966'000.00	0.19	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.19	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.95%	959'500.00	0.19	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.95%	899'500.00	0.17	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	2'000	0	500	1'500 CHF	97.60%	1'464'000.00	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.80%	898'000.00	0.17	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	1'000	1'000	0	2'000 CHF	92.05%	1'841'000.00	0.36	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'000	0	0	1'000 CHF	90.50%	905'000.00	0.18	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.00%	920'000.00	0.18	a)
CH0482172415	0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.60%	976'000.00	0.19	a)
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'500	0	0	1'500 CHF	91.20%	1'368'000.00	0.27	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.19	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.45%	924'500.00	0.18	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	83.65%	836'500.00	0.16	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	2'000	0	0	2'000 CHF	87.25%	1'745'000.00	0.34	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	1'200	1'300	0	2'500 CHF	67.65%	1'691'250.00	0.33	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	1'000	0	0	1'000 CHF	91.30%	913'000.00	0.18	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.10%	951'000.00	0.18	a)
CH0494734335	0.0000 % SCMN VX 0 08/30/44	500	500	0	1'000 CHF	67.50%	675'000.00	0.13	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.00%	930'000.00	0.18	a)
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	0	1'500	500	1'000 CHF	96.25%	962'500.00	0.19	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	1'000	0	0	1'000 CHF	93.15%	931'500.00	0.18	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	1'500	0	0	1'500 CHF	89.53%	1'342'950.00	0.26	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	1'000	0	0	1'000 CHF	90.95%	909'500.00	0.18	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	2'500	0	0	2'500 CHF	93.35%	2'333'750.00	0.45	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	1'000	0	0	1'000 CHF	87.00%	870'000.00	0.17	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	2'000	0	0	2'000 CHF	88.10%	1'762'000.00	0.34	a)
CH0506071379	0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'610	890	0	2'500 CHF	84.50%	2'112'500.00	0.41	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.70%	907'000.00	0.18	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	1'000	0	0	1'000 CHF	91.20%	912'000.00	0.18	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	1'250	0	250	1'000 CHF	89.75%	897'500.00	0.17	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.50%	925'000.00	0.18	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.05%	920'500.00	0.18	a)
CH0520663599	0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	87.65%	876'500.00	0.17	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	1'000	0	0	1'000 CHF	83.10%	831'000.00	0.16	a)
CH0521617313	1.4500 % HELNSW 1.45 08/12/40	1'000	0	0	1'000 CHF	89.45%	894'500.00	0.17	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.30%	913'000.00	0.18	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	1'500	0	0	1'500 CHF	82.70%	1'240'500.00	0.24	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	4'000	0	0	4'000 CHF	85.50%	3'420'000.00	0.66	a)
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	2'650	0	0	2'650 CHF	82.65%	2'190'225.00	0.43	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.00%	950'000.00	0.18	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	86.85%	868'500.00	0.17	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	2'500	0	0	2'500 CHF	71.40%	1'785'000.00	0.35	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	1'000	2'000	0	3'000 CHF	91.22%	2'736'600.00	0.53	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	1'000	0	0	1'000 CHF	76.85%	768'500.00	0.15	a)
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	2'215	285	0	2'500 CHF	84.25%	2'106'250.00	0.41	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	1'000	0	0	1'000 CHF	89.20%	892'000.00	0.17	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	1'000	0	0	1'000 CHF	92.85%	928'500.00	0.18	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	0.19	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	2'500	0	0	2'500 CHF	91.36%	2'284'000.00	0.44	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.75%	977'500.00	0.19	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	0	5'000	0	5'000 CHF	92.90%	4'645'000.00	0.90	a)
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	500	0	0	500 CHF	63.00%	315'000.00	0.06	a)
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	1'500	0	0	1'500 CHF	89.20%	1'338'000.00	0.26	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	750	1'000	0	1'750 CHF	75.70%	1'324'750.00	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	1'000	0	0	1'000 CHF	88.65%	886'500.00	0.17	a)
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	2'000	500	0	2'500 CHF	80.50%	2'012'500.00	0.39	a)
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	88.95%	1'334'250.00	0.26	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	1'000	0	0	1'000 CHF	86.75%	867'500.00	0.17	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	5'000	0	0	5'000 CHF	91.75%	4'587'500.00	0.89	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	84.00%	1'260'000.00	0.24	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.18	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	4'000	0	0	4'000 CHF	85.90%	3'436'000.00	0.67	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	2'500	0	0	2'500 CHF	86.50%	2'162'500.00	0.42	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	2'500	0	0	2'500 CHF	82.05%	2'051'250.00	0.40	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	1'950	0	0	1'950 CHF	75.63%	1'474'785.00	0.29	a)
CH0591979668	0.0000 % CS 0 01/27/33 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	85.00%	2'337'500.00	0.45	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	1'800	0	0	1'800 CHF	86.25%	1'552'500.00	0.30	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.85%	918'500.00	0.18	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	3'000	0	1'000	2'000 CHF	88.35%	1'767'000.00	0.34	a)
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	1'000	0	0	1'000 CHF	87.63%	876'300.00	0.17	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	1'500	0	0	1'500 CHF	79.82%	1'197'300.00	0.23	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	77.15%	1'543'000.00	0.30	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	79.10%	1'186'500.00	0.23	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'500	0	500	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.17	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	2'000	0	0	2'000 CHF	90.45%	1'809'000.00	0.35	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	1'500	0	0	1'500 CHF	88.10%	1'321'500.00	0.26	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'000	0	0	2'000 CHF	89.60%	1'792'000.00	0.35	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	1'500	0	0	1'500 CHF	84.95%	1'274'250.00	0.25	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'000	0	0	1'000 CHF	94.30%	943'000.00	0.18	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	4'000	0	0	4'000 CHF	87.25%	3'490'000.00	0.68	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	1'500	0	0	1'500 CHF	89.20%	1'338'000.00	0.26	a)
CH1101561491	2.1250 % SLHNVX 2 1/8 09/30/41	1'000	0	0	1'000 CHF	90.10%	901'000.00	0.18	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.50%	955'000.00	0.19	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	1'500	0	1'500 CHF	93.40%	1'401'000.00	0.27	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	1'500	0	0	1'500 CHF	91.30%	1'369'500.00	0.27	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	2'000	0	0	2'000 CHF	90.09%	1'801'800.00	0.35	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	1'500	0	0	1'500 CHF	85.50%	1'282'500.00	0.25	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	1'500	0	0	1'500 CHF	80.95%	1'214'250.00	0.24	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	1'000	0	0	1'000 CHF	95.70%	957'000.00	0.19	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	1'000	0	0	1'000 CHF	90.20%	902'000.00	0.18	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.85%	898'500.00	0.17	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	1'000	0	0	1'000 CHF	94.15%	941'500.00	0.18	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	2'000	0	0	2'000 CHF	85.50%	1'710'000.00	0.33	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	0	1'000	0	1'000 CHF	96.50%	965'000.00	0.19	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	750	250	0	1'000 CHF	87.75%	877'500.00	0.17	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	2'500	0	0	2'500 CHF	89.85%	2'246'250.00	0.44	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	3'000	0	0	3'000 CHF	84.97%	2'549'100.00	0.50	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.30%	923'000.00	0.18	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.85%	908'500.00	0.18	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.55%	905'500.00	0.18	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.40%	1'828'000.00	0.36	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	1'000	0	0	1'000 CHF	91.00%	910'000.00	0.18	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'000	0	0	3'000 CHF	97.28%	2'918'400.00	0.57	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.60%	946'000.00	0.18	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.95%	909'500.00	0.18	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.45%	934'500.00	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'000	0	0	1'000 CHF	92.30%	923'000.00	0.18	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	94.70%	1'420'500.00	0.28	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	88.60%	1'329'000.00	0.26	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	90.65%	1'359'750.00	0.26	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'500	0	0	1'500 CHF	94.65%	1'419'750.00	0.28	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	1'550	0	0	1'550 CHF	89.30%	1'384'150.00	0.27	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.45%	944'500.00	0.18	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	750	250	0	1'000 CHF	97.77%	977'700.00	0.19	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	1'000	0	0	1'000 CHF	92.80%	928'000.00	0.18	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	5'000	0	0	5'000 CHF	98.85%	4'942'500.00	0.96	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	3'000	0	0	3'000 CHF	98.71%	2'961'300.00	0.58	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.50%	965'000.00	0.19	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	96.75%	1'451'250.00	0.28	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.28	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.05%	980'500.00	0.19	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.60%	1'972'000.00	0.38	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	1'000	0	0	1'000 CHF	99.25%	992'500.00	0.19	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'500	1'000	1'000	1'500 CHF	97.55%	1'463'250.00	0.28	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.15%	991'500.00	0.19	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.90%	1'483'500.00	0.29	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.80%	988'000.00	0.19	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.19	a)
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.19	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	2'000	1'000	0	3'000 CHF	105.95%	3'178'500.00	0.62	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	1'000	0	0	1'000 CHF	99.65%	996'500.00	0.19	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	1'000	1'500	0	2'500 CHF	99.41%	2'485'250.00	0.48	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	3'000	0	0	3'000 CHF	98.25%	2'947'500.00	0.57	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	3'000	0	1'500	1'500 CHF	98.35%	1'475'250.00	0.29	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.95%	989'500.00	0.19	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	2'000	0	0	2'000 CHF	109.00%	2'180'000.00	0.42	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	1'000	0	0	1'000 CHF	105.35%	1'053'500.00	0.20	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.25%	1'518'750.00	0.30	a)
CH1202242223	1.5203 % NWDIE 1.5203 12/17/29	1'000	0	0	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.19	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	103.60%	1'036'000.00	0.20	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	1'000	0	0	1'000 CHF	101.50%	1'015'000.00	0.20	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	1'000	1'500	0	2'500 CHF	103.45%	2'586'250.00	0.50	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	2'500	2'500	0	5'000 CHF	100.25%	5'012'500.00	0.97	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'500	0	0	1'500 CHF	112.40%	1'686'000.00	0.33	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	100.45%	1'506'750.00	0.29	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	2'000	0	0	2'000 CHF	104.35%	2'087'000.00	0.41	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.20	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	0	1'000	0	1'000 CHF	110.80%	1'108'000.00	0.22	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	2'000	0	0	2'000 CHF	102.85%	2'057'000.00	0.40	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.60%	2'072'000.00	0.40	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	101.35%	1'520'250.00	0.30	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	1'000	0	0	1'000 CHF	100.30%	1'003'000.00	0.19	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.35%	1'023'500.00	0.20	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.20	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	1'000	0	0	1'000 CHF	100.80%	1'008'000.00	0.20	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'500	0	0	1'500 CHF	99.60%	1'494'000.00	0.29	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.20	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	1'000	0	1'000 CHF	101.55%	1'015'500.00	0.20	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	99.70%	2'492'500.00	0.48	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.20	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	1'000	0	1'000 CHF	100.60%	1'006'000.00	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.20	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROI 2.15 12/19/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.75%	1'017'500.00	0.20	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	0	920	920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	0	1'000	0	1'000 CHF	110.75%	1'107'500.00	0.22	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	1'000	0	1'000 CHF	110.00%	1'100'000.00	0.21	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	1'500	0	1'500 CHF	100.55%	1'508'250.00	0.29	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.80%	1'018'000.00	0.20	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLILI 2 3/4 03/01/30	0	1'500	0	1'500 CHF	104.35%	1'565'250.00	0.30	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.45%	1'521'750.00	0.30	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.10%	1'011'000.00	0.20	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.05%	2'061'000.00	0.40	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.20	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.75%	1'037'500.00	0.20	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	1'000	0	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.20	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	1'450	0	1'450 CHF	102.75%	1'489'875.00	0.29	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.30	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	1'500	0	1'500 CHF	105.85%	1'587'750.00	0.31	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.75%	1'541'250.00	0.30	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	103.65%	1'554'750.00	0.30	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	1'500	0	1'500 CHF	101.05%	1'515'750.00	0.29	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.05%	1'530'750.00	0.30	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.20	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.60%	1'524'000.00	0.30	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.70%	1'047'000.00	0.20	a)
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.45%	1'034'500.00	0.20	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.15%	1'021'500.00	0.20	a)
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.45%	1'014'500.00	0.20	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	1'500	0	1'500 CHF	102.95%	1'544'250.00	0.30	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	1'000	0	1'000 CHF	103.30%	1'033'000.00	0.20	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.55%	1'508'250.00	0.29	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.20	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	1'500	0	1'500 CHF	106.40%	1'596'000.00	0.31	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	0	1'600	600	1'000 CHF	100.50%	1'005'000.00	0.20	a)
CH1274703136	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47 SEPT	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.65%	1'046'500.00	0.20	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSFC 2.9325 07/04/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.75%	1'037'500.00	0.20	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	5'000	0	5'000 CHF	106.16%	5'308'000.00	1.03	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	1'000	0	1'000 CHF	102.55%	1'025'500.00	0.20	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.70%	1'525'500.00	0.30	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.40%	1'044'000.00	0.20	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.85%	1'527'750.00	0.30	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.40%	2'028'000.00	0.39	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.20	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	1'000	0	1'000 CHF	100.90%	1'009'000.00	0.20	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	1'000	0	1'000 CHF	101.80%	1'018'000.00	0.20	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.55%	1'538'250.00	0.30	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	1'000	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.20	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	1'000	0	1'000 CHF	101.50%	1'015'000.00	0.20	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	1'500	0	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.29	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.20	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	1'000	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.20	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	1'000	0	1'000 CHF	104.70%	1'047'010.00	0.20	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.20	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.55%	1'025'500.00	0.20	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.00%	1'515'000.00	0.29	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	1'000	0	1'000 CHF	101.50%	1'015'000.00	0.20	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.40%	1'024'000.00	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.12.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'500	0	1'500 CHF	100.90%	1'513'500.00	0.29	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	100.90%	1'513'500.00	0.29	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	2'000	0	2'000 CHF	103.20%	2'064'000.00	0.40	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	2'500	0	2'500 CHF	103.40%	2'585'000.00	0.50	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	2'000	0	2'000 CHF	103.23%	2'064'520.00	0.40	a)
CH1306117032	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 NOV	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CHF							509'586'490.00	99.01	

Nicht kotierte Wertpapiere

0.00 0.00

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

986793230227	2.0000 % KASSEN OBLIGATION CHF CEMBRA MONEY BANK 27.02.2023	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
--------------	--	-----	---	-----	-------	-------	------	------	--

CHF 0.00 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'573'534.77	0.50
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	509'586'490.00	99.01
Sonstige Vermögenswerte	2'507'959.34	0.49
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'667'984.11	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-66'149.94	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	514'601'834.17	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	509'586'490.00	99.01
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.12.2022 - 30.11.2023

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.12.2022 - 30.11.2023

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
Q	0.150	1.000	4.000

Periode: 02.06.2023 - 30.11.2023

Klasse	VK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in % Max
A	0.450	2.000	4.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der 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

SBI AAA-BBB TR

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: 19.03.2024 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 22.03.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Nein	CHF	0.00000	0.00000	0.00000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 19.03.2024 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 22.03.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
Q	Nein	CHF	0.59088	0.20680	0.38408

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag berechnet, an dem Anteile des entsprechenden Teilvermögens ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet (Ausgabetag bzw. Rücknahmetag). Die massgeblichen Ausgabe- oder Rücknahmetage sind für jedes Teilvermögen im Besonderen Teil genannt. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer 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 oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens im Sinne von § 6 Ziff. 1 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. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in

Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

AKB Portfoliofonds

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

(nachstehend «der Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

Betreffend die geplante Fondsvertragsänderung erfolgte bereits am 1. November 2022 eine Mitteilung auf der Internetplattform www.fundinfo.com.

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

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

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

Zürich, 2. Dezember 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

AKB Portfoliofonds

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

(nachfolgend «Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

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

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

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

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

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

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

AKB Portfolio Teilvermögen als Dachfonds

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

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

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

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

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

AKB Vorsorge Teilvermögen als Dachfonds

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

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

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

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

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

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus als Zielfonds

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

AKB Obligationen CHF ESG Fokus als Zielfonds

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

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus als Zielfonds

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

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

3. Anpassung Risikoverteilung betreffend Dach-/Zielfondsquote

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

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

*Teilvermögen des Umbrella-Fonds AKB Institutional Funds

4. Diverse Anpassungen

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

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

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{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 umschriebenen Änderungen der Ziffern 1 bis 3 des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen

die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

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

Zürich, 24. Februar 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

AKB Portfoliofonds

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

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

Betreffend die geplante Fondsvertragsänderung erfolgte bereits am 24. Februar 2023 eine Mitteilung auf der Internetplattform www.fundinfo.com.

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

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

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

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

Zürich, 30. März 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

AKB Portfoliofonds

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

mit den Teilvermögen

AKB Einkommen CHF ESG Fokus

AKB Rendite CHF ESG Fokus

AKB Rendite EUR ESG Fokus

AKB Ausgewogen CHF ESG Fokus

AKB Wachstum CHF ESG Fokus

AKB Aktien CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 15 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 30 CHF ESG Fokus

AKB Vorsorge 45 CHF ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Top Selection ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Plus ESG Fokus

AKB Aktien Schweiz Nebenwerte ESG Fokus

AKB Obligationen CHF ESG Fokus

AKB Obligationen Welt hedged CHF ESG Fokus

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

* * *

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{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 Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 8. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich