

Jahresbericht

CS Fund 2

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

30. September 2023

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	4
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	15
Erläuterungen zum Jahresbericht	40
Bericht der Prüfgesellschaft	45

Verwaltung und Organe

Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident (ab 1. März 2023, Mitglied ab 2. November 2022 bis 28. Februar 2023)
- Luca Diener, Vizepräsident
- Patrick Tschumper, Mitglied (ab 1. März 2023, Präsident bis 28. Februar 2023)
- Jürg Roth, Mitglied
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Thomas Vonaesch, Mitglied
- Christian Schärer, Mitglied (bis 1. November 2022)
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Hans Peter Bär, Mitglied (ab 1. April 2023)

Geschäftsleitung

- Thomas Schärer, CEO
- Emil Stark, stellvertretender CEO und Leiter Fund Solutions AM
- Gilbert Eyb, Mitglied, Legal
- Naftali Halonbrenner, Mitglied, Fund Services
- Hans Christoph Nickl, Mitglied, COO
- David Dubach, Mitglied, Oversight & ManCo Services
- Gabriele Wyss, Mitglied, Compliance
- Christian Bieri, Mitglied, Real Estate Fund Management
- Marcus Eberlein, Mitglied, Performance & Risk Management
- Ralph Warth, Mitglied, Fund Solutions PLF

Depotbank

Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG, Zürich

Informationen über Dritte

Übertragung der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide sind an die Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich, als Vermögensverwalter übertragen.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben der Fondsadministration an nachfolgende Gruppengesellschaften der UBS Group AG übertragen:

- Credit Suisse AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Rechts- und Complianceberatung, Facility Management und Management Information System MIS.
- Credit Suisse (Schweiz) AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Personalwesen Collateral Management, IT Dienstleistungen und First Line of Defense Support (FLDS).
- Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Schweiz: Real Estate Administration (u.a. Fonds- und Liegenschaftsbuchhaltung, Liegenschaftenverwaltung).
- Credit Suisse Services AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Finanzwesen der Fondsleitung und Steuerberatung.
- Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxembourg: Teilaufgaben im Bereich der Fondsbuchhaltung sowie Unterstützung bei der Überwachung der Anlagevorschriften.
- Credit Suisse (Poland) Sp.z.o.o., Polen: Teilaufgaben in den Bereichen Fondsbuchhaltung, Information Management (u.a. Produkt-Masterdaten, Preis-Publikationen, Factsheet-Produktion, Basisinformationsblatt-Produktion und Erstellen von Reportings), Legal Reporting (Erstellung des Jahresberichts) sowie weitere Supportaufgaben.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und den genannten Gruppengesellschaften abgeschlossener Vertrag. Es besteht die Möglichkeit, den genannten Gruppengesellschaften weitere Teilaufgaben zu übertragen.

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidierung				
Nettobondsvermögen in Mio.	CHF	83.33	122.37	158.38
Anteilklasse A				
Nettobondsvermögen in Mio.	CHF	59.22	89.05	124.57
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	105.08	101.80	116.73
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	105.45	102.16	116.52
Anteilklasse EA				
Nettobondsvermögen in Mio.	CHF	13.98	16.35	11.97
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	935.68	906.88	1'040.04
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	938.97	910.07	1'038.18
Anteilklasse IA				
Nettobondsvermögen in Mio.	CHF	5.36	11.63	13.68
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	928.52	899.91	1'032.06
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	931.78	903.07	1'030.21
Anteilklasse UA				
Nettobondsvermögen in Mio.	CHF	4.77	5.35	8.17
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	91.50	88.66	101.66
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	91.82	88.97	101.48

Verwendung des Erfolges**Ausschüttung pro Anteil****1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber**

Ausschüttung 2023		Anteilklasse A	Anteilklasse EA	Anteilklasse IA
Bruttoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.680	CHF 11.660	CHF 11.100
./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF	0.238	CHF 4.081	CHF 3.885
Nettoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.442	CHF 7.579	CHF 7.215
Coupon Nr. Ertrag		31	10	11

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Ausschüttung 2023		Anteilklasse A	Anteilklasse EA	Anteilklasse IA
Bruttoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.680	CHF 11.660	CHF 11.100
Nettoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.680	CHF 11.660	CHF 11.100
Coupon Nr. Ertrag		31	10	11

Zahlbar ab 16.11.2023 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber

Ausschüttung 2023		Anteilklasse UA
Bruttoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.920
./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF	0.322
Nettoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.598
Coupon Nr. Ertrag		9

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Ausschüttung 2023		Anteilklasse UA
Bruttoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.920
Nettoausschüttung aus Ertrag	CHF	0.920
Coupon Nr. Ertrag		9

Zahlbar ab 16.11.2023 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

Wechselkurse

Wechselkurse per	30.09.2023
ENGLISCHES PFUND	1.116613
EURO	0.968550
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.914805

Vermögensrechnung per 30. September 2023

	Konsolidierung	
	30.09.2023	30.09.2022
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	814'880.89	1'535'652.08
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	82'256'834.93	119'903'504.31
- Strukturierte Produkte	0.54	0.54
Derivative Finanzinstrumente	-392'823.65	-34'803.23
Sonstige Vermögenswerte	720'276.85	1'072'793.03
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	83'399'169.56	122'477'146.73
Andere Verbindlichkeiten	71'325.26	104'721.18
Nettofondsvermögen	83'327'844.30	122'372'425.55
	Konsolidierung	
	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	122'372'425.55	158'381'469.88
Ausschüttungen	-695'845.52	-740'518.56
Ausgaben von Anteilen	4'167'796.97	17'182'122.65
Rücknahmen von Anteilen	-46'478'176.01	-34'648'976.09
Sonstiges aus Anteilverkehr	1'100'478.57	-1'233'907.63
Gesamterfolg	2'861'164.74	-16'567'764.70
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	83'327'844.30	122'372'425.55
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	962'628.807	1'174'351.436
Ausgegebene Anteile	14'346.185	45'509.507
Zurückgenommene Anteile	-342'842.755	-257'232.136
Bestand am Ende der Berichtsperiode	634'132.237	962'628.807
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)		
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)		

Anteilklasse A		Anteilklasse EA		Anteilklasse IA		Anteilklasse UA	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022						
CHF							
89'051'300.37	124'566'873.03	16'346'994.30	11'967'153.19	11'628'304.51	13'678'045.09	5'345'826.39	8'169'398.61
-359'809.99	-443'615.86	-176'514.24	-115'688.08	-117'461.45	-125'584.19	-42'059.84	-55'630.43
1'153'168.84	3'594'006.51	2'954'346.86	12'811'326.42	60'281.27	761'799.32	0.00	14'990.40
-33'366'328.24	-25'561'181.20	-5'808'532.93	-5'943'087.12	-6'567'509.92	-1'166'505.70	-735'804.92	-1'978'202.07
788'183.97	-881'908.58	122'743.59	-264'561.97	165'920.95	1'698.13	23'630.06	-89'135.23
1'951'144.57	-12'222'873.53	544'790.75	-2'108'148.14	190'080.65	-1'521'148.14	175'148.77	-715'594.89
59'217'659.52	89'051'300.37	13'983'828.33	16'346'994.30	5'359'616.01	11'628'304.51	4'766'740.46	5'345'826.39
871'704.572	1'069'047.078	17'962.382	11'527.009	12'876.362	13'276.896	60'085.491	80'500.453
11'090.037	31'763.430	3'190.871	12'783.173	65.277	802.904	0.000	160.000
-321'221.407	-229'105.936	-6'260.522	-6'347.800	-7'189.633	-1'203.438	-8'171.193	-20'574.962
561'573.202	871'704.572	14'892.731	17'962.382	5'752.006	12'876.362	51'914.298	60'085.491
(CHF)							
105.08	101.80	935.68	906.88	928.52	899.91	91.50	88.66
105.45	102.16	938.97	910.07	931.78	903.07	91.82	88.97

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

	Konsolidierung	
	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	12'986.48	187.31
Negativzinsen	-1'837.46	-18'402.34
Erträge der Effektenleihen	32'626.75	35'674.45
Erträge der Ausgleichszahlungen	231'066.98	329'353.94
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'515'017.40	1'683'045.57
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	27'117.09	97'491.15
Total Erträge	1'816'977.24	2'127'350.08
Aufwendungen		
Passivzinsen	1'053.74	2'462.79
Prüfaufwand	14'494.70	14'916.83
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	841'221.35	1'197'963.37
- die Depotbank	43'716.18	60'917.30
Sonstige Aufwendungen	8'002.69	12'189.84
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	261'624.71	158'859.12
Total Aufwendungen	1'170'113.37	1'447'309.25
Nettoertrag	646'863.87	680'040.83
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-3'114'652.47	-2'314'035.28
Realisierter Erfolg	-2'467'788.60	-1'633'994.45
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5'328'953.34	-14'933'770.25
Gesamterfolg	2'861'164.74	-16'567'764.70
Verwendung des Erfolgs		
Nettoertrag des Rechnungsjahres	646'863.87	680'040.83
Vortrag des Vorjahres	229'411.35	249'471.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	876'275.22	929'512.17
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	667'127.44	700'100.82
Vortrag auf neue Rechnung	209'147.78	229'411.35

Anteilklasse A		Anteilklasse EA		Anteilklasse IA		Anteilklasse UA	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022						
CHF							
9'157.80	135.43	2'122.19	27.20	1'025.19	16.82	681.30	7.86
-1'324.20	-13'402.44	-251.93	-2'549.66	-178.68	-1'629.63	-82.65	-820.61
23'228.07	26'311.68	5'095.12	4'602.88	2'670.95	3'127.75	1'632.61	1'632.14
163'101.62	241'078.75	36'769.36	44'511.66	19'737.85	28'902.68	11'458.15	14'860.85
1'076'512.43	1'248'896.90	236'937.92	208'392.41	125'536.82	147'563.81	76'030.23	78'192.45
3'432.47	6'912.21	23'279.17	82'835.29	405.45	7'633.52	0.00	110.13
1'274'108.19	1'509'932.53	303'951.83	337'819.78	149'197.58	185'614.95	89'719.64	93'982.82
749.46	1'810.45	176.53	314.63	67.61	213.38	60.14	124.33
10'267.46	11'039.63	2'313.34	1'880.73	1'177.92	1'309.80	735.98	686.67
712'335.95	1'036'038.79	59'980.17	67'013.98	36'947.21	53'370.55	31'958.02	41'540.05
31'050.34	45'160.75	6'797.72	7'594.86	3'694.98	5'336.96	2'173.14	2'824.73
5'749.65	9'231.02	1'158.09	1'297.33	716.68	1'061.60	378.27	599.89
136'707.94	70'997.85	60'186.73	67'893.76	58'858.86	9'046.56	5'871.18	10'920.95
896'860.80	1'174'278.49	130'612.58	145'995.29	101'463.26	70'338.85	41'176.73	56'696.62
377'247.39	335'654.04	173'339.25	191'824.49	47'734.32	115'276.10	48'542.91	37'286.20
-2'214'825.29	-1'684'360.65	-521'785.83	-308'880.72	-199'994.87	-219'744.32	-178'046.48	-101'049.59
-1'837'577.90	-1'348'706.61	-348'446.58	-117'056.23	-152'260.55	-104'468.22	-129'503.57	-63'763.39
3'788'722.47	-10'874'166.92	893'237.33	-1'991'091.91	342'341.20	-1'416'679.92	304'652.34	-651'831.50
1'951'144.57	-12'222'873.53	544'790.75	-2'108'148.14	190'080.65	-1'521'148.14	175'148.77	-715'594.89
377'247.39	335'654.04	173'339.25	191'824.49	47'734.32	115'276.10	48'542.91	37'286.20
127'865.56	158'327.44	52'341.68	34'752.30	35'251.58	37'665.43	13'952.53	18'726.17
505'112.95	493'981.48	225'680.93	226'576.79	82'985.90	152'941.53	62'495.44	56'012.37
381'869.78	366'115.92	173'649.24	174'235.11	63'847.27	117'689.95	47'761.15	42'059.84
123'243.17	127'865.56	52'031.69	52'341.68	19'138.63	35'251.58	14'734.29	13'952.53

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Anleihen							
Australien							
0.113	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.113%/19-10.12.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	881'500.00	1.06
1.285	MACQUARIE GROUP LTD 1.285%/22-11.09.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	928'000.00	1.11
0.293	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.2925%/22-03.02.2028	CHF	1'500'000	500'000	1'000'000	925'500.00	1.11
						2'735'000.00	3.28
Chile							
2.718	EMBOTELLADORA ANDINA SA 2.7175%/23-20.09.2028	CHF		300'000	300'000	300'450.00	0.36
0.385	SCOTIABANK CHILE 0.385%/21-22.07.2026	CHF	1'460'000		1'460'000	1'367'290.00	1.64
						1'667'740.00	2.00
Deutschland							
0.625	DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023	CHF	2'000'000	2'000'000			
3.645	DEUTSCHE BANK AG 3.645%/23-27.01.2029	CHF		1'000'000	1'000'000	1'000'500.00	1.20
0.435	DEUTSCHE TELEKOM AG 0.435%/20-06.02.2032	CHF	2'000'000	500'000	1'500'000	1'310'250.00	1.57
2.625	DZ BANK AG 2.625%/23-27.08.2029	CHF		1'000'000	1'000'000	991'500.00	1.19
2.503	E.ON SE 2.5025%/22-05.12.2029	CHF		1'000'000	1'000'000	1'015'500.00	1.22
4.253	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK (subordinated) 4.2525%/23-07.06.2033	CHF		800'000	800'000	812'000.00	0.97
0.300	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.3%/17-20.12.2024	CHF	2'000'000	1'000'000	1'000'000	977'600.00	1.17
						6'107'350.00	7.32
Finnland							
1.810	NORDEA BANK ABP 1.81%/22-15.06.2027	CHF	1'400'000		1'400'000	1'367'800.00	1.64
						1'367'800.00	1.64
Frankreich							
1.000	BNP PARIBAS SA 1%/18-06.06.2025	CHF	1'000'000		1'000'000	978'000.00	1.17
2.125	CREDIT AGRICOLE (subordinated.) 2.125%/01-29.09.2025	CHF	2'000'000	1'500'000	500'000	498'250.00	0.60
2.490	ENGIE SA 2.49%/23-04.07.2031	CHF		1'000'000	1'000'000	1'013'000.00	1.21
1.005	MFINANCE FRANCE 1.005%/17-28.03.2023	CHF	2'000'000	2'000'000			
0.625	ORANGE SA 0.625%/19-22.06.2029	CHF	1'850'000	450'000	1'400'000	1'296'400.00	1.55
3.500	RCI BANQUE SA 3.5%/23-10.05.2028	CHF		1'000'000	1'000'000	1'026'500.00	1.23
0.700	SOCIETE GENERALE 0.7%/18-26.02.2025	CHF	2'000'000	2'000'000			
2.618	SOCIETE GENERALE 2.6175%/23-27.02.2030	CHF		1'500'000	1'500'000	1'510'500.00	1.81
						6'322'650.00	7.58
Grossbritannien							
0.813	HSBC HOLDINGS PLC 0.8125%/21-03.11.2031	CHF	1'600'000		1'600'000	1'367'200.00	1.64
1.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025	CHF	2'000'000	1'000'000	1'000'000	982'400.00	1.18
1.915	NATIONWIDE BLDG SOCIETY 1.915%/22-08.09.2028	CHF		1'000'000	1'000'000	967'000.00	1.16
0.898	NATWEST MARKETS PLC 0.8975%/22-04.04.2025	CHF	1'000'000		1'000'000	979'500.00	1.17
0.375	VODAFONE GROUP 0.375%/16-03.12.2024	CHF	2'000'000	1'500'000	500'000	490'350.00	0.59
						4'786'450.00	5.74
Irland							
0.250	INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	CHF	2'000'000	1'600'000	400'000	392'440.00	0.47
						392'440.00	0.47
Kanada							
0.050	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	CHF	2'000'000	1'000'000	1'000'000	934'500.00	1.12
0.200	ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-22.09.2031	CHF	1'500'000		1'500'000	1'266'750.00	1.52
2.203	TORONTO-DOMINION BANK 2.2025%/23-31.01.2028	CHF		1'000'000	1'000'000	996'000.00	1.19
						3'197'250.00	3.83
Liechtenstein							
0.200	LGT BANK LTD 0.2%/20-04.11.2030	CHF	2'000'000	500'000	1'500'000	1'295'250.00	1.55
						1'295'250.00	1.55
Luxemburg							
0.732	AROUNDTOWN SA 0.732%/18-30.01.2025	CHF	1'500'000	1'000'000	500'000	470'000.00	0.56
						470'000.00	0.56
Mexiko							
0.500	BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	CHF	940'000		940'000	907'100.00	1.09
						907'100.00	1.09
Neuseeland							
0.350	ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.35%/18-22.10.2024	CHF	2'000'000	2'000'000			
0.038	TRANSPower NEW ZEALAND LIMITED 0.038%/21-16.03.2029	CHF	1'010'000		1'010'000	912'030.00	1.09
						912'030.00	1.09
Niederlande							
0.300	ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024	CHF	1'300'000	1'300'000			
2.625	ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-02.03.2028	CHF		1'600'000	1'600'000	1'599'200.00	1.92

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
0.750 BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	CHF	2'000'000		1'000'000	1'000'000	960'500.00	1.15
3.125 COOPERATIEVE RABOBANK UA 3.125%/06-15.09.2026	CHF	1'500'000		1'500'000			
0.850 DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 0.85%/18-14.11.2025	CHF	2'000'000		2'000'000			
1.700 DIGITAL INTREPID HOLDING 1.7%/22-30.03.2027	CHF	1'000'000			1'000'000	959'500.00	1.15
2.625 ENBW INTL FINANCE BV 2.625%/23-15.06.2029	CHF		1'000'000		1'000'000	1'016'500.00	1.22
2.130 TOYOTA MOTOR FINANCE (NETHERLANDS) BV 2.13%/23-15.06.2027	CHF		390'000		390'000	391'170.00	0.47
						4'926'870.00	5.91
Norwegen							
1.168 DNB BANK ASA 1.1675%/22-03.06.2027	CHF	1'500'000		500'000	1'000'000	966'000.00	1.16
0.125 SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025	CHF	1'000'000			1'000'000	957'000.00	1.15
1.500 SPAREBANK 1 SMN 1.5%/22-15.06.2027	CHF	1'000'000			1'000'000	971'500.00	1.16
						2'894'500.00	3.47
Österreich							
2.870 BAWAG P.S.K. 2.87%/22-03.10.2025	CHF	1'000'000			1'000'000	1'008'000.00	1.21
3.125 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.125%/06-01.09.2031	CHF	800'000			800'000	867'200.00	1.04
0.250 ERSTE GROUP BANK AG 0.25%/21-02.10.2028	CHF	1'500'000			1'500'000	1'339'500.00	1.61
1.625 HYPO VORARLBERG BANK AG (subordinated) 1.625%/19-29.11.2029	CHF	2'000'000		500'000	1'500'000	1'328'250.00	1.59
						4'542'950.00	5.45
Schweiz							
0.875 ADECCO GROUP INC 0.875%/18-18.09.2026	CHF	1'500'000		1'500'000			
2.200 BALOISE LIFE LTD (subordinated) FRN FF/17-19.06.2048	CHF	1'900'000		900'000	1'000'000	942'500.00	1.13
0.600 BUEHLER HOLDING AG 0.6%/17-21.12.2026	CHF	2'000'000		1'000'000	1'000'000	950'500.00	1.14
0.875 GEORG FISCHER FINANZ LTDÄ.Ä. 0.875%/16-12.05.2026	CHF	500'000		500'000			
- HELVETIA SCHWEIZERISCHE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-12.08.2040	CHF	1'000'000			1'000'000	870'500.00	1.04
1.000 LAFARGEHOLCIM LTD 1%/18-11.12.2024	CHF	1'000'000		1'000'000			
0.400 PARTNERS GROUP HOLDING A 0.4%/19-21.06.2027	CHF	1'550'000		550'000	1'000'000	939'500.00	1.13
1.000 ROCHE KAPITALMARKT AG 1%/22-25.02.2037	CHF	2'000'000		500'000	1'500'000	1'327'500.00	1.59
- SONOVA HOLDING LTD. 0%/19-11.10.2029	CHF	1'200'000			1'200'000	1'077'600.00	1.29
- SWIFF LIFE (reg. -S-) T. -2- FIX-TO-FRN 4.375%/16-24.09.2046	CHF	1'500'000			1'500'000	1'526'250.00	1.83
0.825 SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.825%/17-11.05.2026	CHF	2'000'000		1'000'000	1'000'000	966'000.00	1.16
0.150 UBS AG LONDON 0.15%/21-29.06.2028	CHF	1'500'000		1'000'000	500'000	454'500.00	0.54
- UBS GROUP AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	CHF	1'000'000			1'000'000	860'000.00	1.03
- ZURICH INSURANCE CO (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-03.05.2052	CHF	1'500'000			1'500'000	1'267'500.00	1.52
						11'182'350.00	13.41
Spanien							
0.477 CAIXABANK S.A. 0.477%/21-01.07.2027	CHF	1'000'000			1'000'000	930'000.00	1.12
0.775 CELLNEX TELECOM SA 0.775%/20-18.02.2027	CHF	2'000'000		500'000	1'500'000	1'406'250.00	1.69
2.933 SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 2.9325%/23-04.07.2028	CHF		1'000'000		1'000'000	1'019'000.00	1.22
						3'355'250.00	4.02
Vereinigte Staaten							
1.375 AT&T 1.375%/14-04.12.2024	CHF	2'000'000		2'000'000			
0.253 BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026	CHF	2'000'000		2'000'000			
0.500 CITIGROUP INC 0.5%/17-22.11.2024	CHF	1'000'000		1'000'000			
0.250 CITIGROUP INC S. -C- 0.25%/21-30.08.2029	CHF	1'000'000			1'000'000	884'500.00	1.06
2.875 EQUINIX INC 2.875%/23-12.09.2028	CHF		860'000		860'000	872'900.00	1.05
1.000 GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	CHF	2'000'000		1'000'000	1'000'000	974'500.00	1.17
0.375 JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.375%/17-18.07.2025	CHF	1'000'000		1'000'000			
0.170 MCDONALD'S CORP 0.17%/16-04.10.2024	CHF	2'000'000		2'000'000			
0.300 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.3%/17-19.01.2026	CHF	2'000'000		1'000'000	1'000'000	959'500.00	1.15
0.125 NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.125%/20-11.09.2029	CHF	2'000'000		500'000	1'500'000	1'326'750.00	1.59
1.000 VERIZON COMMUNICATIONS 1%/17-30.11.2027	CHF	2'500'000		1'500'000	1'000'000	956'500.00	1.15
1.250 WELLS FARGO & CO 1.25%/14-03.09.2024	CHF	1'000'000			1'000'000	991'100.00	1.19
						6'965'750.00	8.35
Total Anleihen						64'028'730.00	76.77
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						64'028'730.00	76.77
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Anleihen							
Belgien							
2.375 BARRY CALLEBAUT SERVICES 2.375%/16-24.05.2024	EUR	2'000'000		2'000'000			
- SOLVAY SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	EUR	100'000		100'000			
						0.00	0.00
Deutschland							
4.000 COMMERZBANK AG 4%/17-30.03.2027	EUR	1'000'000			1'000'000	942'360.41	1.13
- DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (subordinated) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	EUR	1'500'000			1'500'000	1'166'284.33	1.40

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
- MUNICH RE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-26.05.2049	EUR	1'000'000			1'000'000	877'254.48	1.05
						2'985'899.22	3.58
Finnland							
- NORDEA BANK (subordinated) (reg. -S-) T. 11 FIX-TO-FRN 6.125%/14-PERPETUAL	USD	300'000			300'000	262'613.13	0.31
						262'613.13	0.31
Frankreich							
- AXA (subordinated) (reg. S-) S. 36 FIX-TO-FRN 3.941%/14-PERPETUAL	EUR	1'000'000			1'000'000	948'539.76	1.14
- BNP PARIBAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-20.11.2030	EUR	1'000'000			1'000'000	911'938.25	1.09
- SOLVAY FINANCE (subordinated) FIX-TO-FRN 5.869%/15-PERPETUAL	EUR	500'000		500'000			
- TOTAL (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 2.625%/15-PERPETUAL	EUR	1'000'000			1'000'000	926'728.01	1.11
						2'787'206.02	3.34
Grossbritannien							
- HSBC HOLDINGS FIX-TO-FRN 6.375%/14-PERPETUAL	USD	550'000		550'000			
4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026	USD	2'000'000		2'000'000			
						0.00	0.00
Kanada							
3.850 THOMSON REUTERS 3.85%/14-29.09.2024	USD	230'000		230'000			
						0.00	0.00
Mexiko							
4.000 MEXICHEM SAB DE CV 4%/17-04.10.2027	USD	250'000		250'000			
2.625 SIGMA ALIMENTOS SA DE CV SIGMA (reg. -S-) 2.625%/17-07.02.2024	EUR	1'050'000		1'050'000			
						0.00	0.00
Niederlande							
- COOPERATIEVE RABOBANK UA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	EUR	1'000'000			1'000'000	886'746.27	1.06
- ELM (subordinated) FIX-TO-FRN 2.6%/15-PERPETUAL	EUR	1'000'000			1'000'000	909'110.09	1.09
1.625 GIVAUDAN FIN EUROPE 1.625%/20-22.04.2032	EUR	1'500'000			1'500'000	1'192'914.61	1.43
- IBERDROLA INTL BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR		1'200'000		1'200'000	954'482.78	1.14
- NN GROUP (subordinated) FIX-TO-FRN 4.5%/14-PERPETUAL	EUR	1'500'000			1'500'000	1'403'516.12	1.68
7.375 TEVA PHARM FNC NL II 7.375%/23-15.09.2029	EUR		850'000		850'000	837'913.43	1.00
1.000 TEVA PHARMACEUTIC FINANCIAL 1%/16-28.07.2025	CHF	1'200'000		1'200'000			
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) S. -NC10- FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	EUR	1'500'000			1'500'000	1'294'147.45	1.55
						7'478'830.75	8.97
Portugal							
- ENERGIAS DE PORTUGAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/23-23.04.2083	EUR		500'000		500'000	480'642.94	0.58
						480'642.94	0.58
Schweden							
- SVENSKA HANDELSBANKEN AB (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	USD	1'400'000			1'400'000	981'831.14	1.18
						981'831.14	1.18
Schweiz							
- CREDIT SUISSE FIX-TO-FRN 3.875%/17-22.09.2049	CHF	1'500'000		1'500'000			
						0.00	0.00
Vereinigte Arabische Emirate							
3.500 EMIRATES TELECOMMUNICATIONS 3.5%/14-18.06.2024	USD	1'000'000		1'000'000			
						0.00	0.00
Vereinigte Staaten							
8.570 BANK OF AMERICA (subordinated) S. B T.1 8.57%/94-15.11.2024	USD	250'000		250'000			
3.375 BAYER US FINANCE II LLC 3.375%/18-15.07.2024	USD	2'000'000		2'000'000			
0.875 CHUBB INA HOLDINGS INC 0.875%/19-15.12.2029	EUR	1'550'000		550'000	1'000'000	795'140.81	0.95
4.000 GLENCORE FUNDING 4%/15-16.04.2025	USD	1'500'000		500'000	1'000'000	887'754.41	1.06
1.625 MONDELEZ INTERNATIONAL 1.625%/15-08.03.2027	EUR	400'000			400'000	360'002.29	0.43
2.125 WALGREENS BOOTS 2.125%/14-20.11.2026	EUR	1'000'000		1'000'000			
2.425 ZIMMER BIOMET HOLDINGS 2.425%/16-13.12.2026	EUR	1'500'000		500'000	1'000'000	919'066.78	1.10
						2'961'964.29	3.55
Total Anleihen						17'938'987.49	21.51
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						17'938'987.49	21.51
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten							
Anleihen							
Island							
- GLITNIR 0%/16-08.01.2030	EUR	89'792			89'792	217.42	0.00
						217.42	0.00
Schweiz							
- SAIRGROUP 0%/98-07.07.2005	CHF	4'000'000			4'000'000	42'800.00	0.05

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
6.250 SAIRGROUP 6.25%/95-12.04.2005	CHF	3'000'000			3'000'000	32'100.00	0.04
- SAIRGROUP FRN 88-15.02.2013 (MATURED)	CHF	20'000'000			20'000'000	214'000.00	0.26
						288'900.00	0.35
Vereinigte Staaten							
12.750 WINSTAR COMMUNICATIONS 12.75%/00-15.04.2010	EUR	1'500'000			1'500'000	0.02	0.00
						0.02	0.00
Total Anleihen						289'117.44	0.35
Strukturierte Produkte							
Island							
GLITNIR HOLDCO EHF HLUASKIRTEINI AHLUTIR SHARE CERTIFICATE A SHARES	EUR	557'598	557'598	557'598	557'598	0.54	0.00
						0.54	0.00
Total Strukturierte Produkte						0.54	0.00
Total Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten						289'117.98	0.35
Derivative Finanzinstrumente							
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Devisentermingeschäfte							
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-392'823.65	-0.47
Total Devisentermingeschäfte						-392'823.65	-0.47
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						-392'823.65	-0.47
Total Derivative Finanzinstrumente						-392'823.65	-0.47
Total Anlagen						81'864'011.82	98.16
Bankguthaben auf Sicht						814'880.89	0.98
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						720'276.85	0.86
Gesamtfondsvermögen (GFV)						83'399'169.56	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						71'325.26	0.09
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettobondsvermögen						83'327'844.30	99.91

(1) Umfassen auch Corporate Actions

Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	64'028'730.00	76.77
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	17'546'163.84	21.04
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	289'117.98	0.35

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
09.11.2022	Bought	CHF	19'697'565	EUR	20'200'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	8'647'111	USD	9'100'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	600'000	CHF	581'478	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	300'000	CHF	283'127	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	120'000	CHF	114'654	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	100'000	CHF	97'694	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	18'955'142	EUR	19'200'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	393'667	EUR	400'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	8'583'951	USD	8'700'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	900'000	CHF	844'195	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	900'000	CHF	853'906	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	19'289'791	EUR	19'600'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	6'463'048	USD	6'950'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	91'855	USD	100'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	USD	500'000	CHF	464'345	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	19'408'637	EUR	19'700'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	499'581	EUR	500'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	6'021'728	USD	6'600'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	1'000'000	CHF	984'219	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	1'500'000	CHF	1'492'428	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
28.04.2023	Bought	EUR	550'000	CHF	541'250	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	2'000'000	CHF	1'870'004	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	500'000	CHF	447'912	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	150'000	CHF	138'277	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	650'000	CHF	588'291	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	16'815'352	EUR	17'150'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	2'921'543	USD	3'300'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	900'000	CHF	872'553	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	15'821'905	EUR	16'300'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	2'973'334	USD	3'330'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	15'362'120	EUR	16'200'000	-289'527.98	-0.35
08.11.2023	Bought	CHF	2'916'491	USD	3'340'000	-126'562.13	-0.15
08.11.2023	Bought	USD	990'000	CHF	878'558	23'266.46	0.03
Total Devisentermingeschäfte						-392'823.65	-0.47

Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)

Titelbezeichnung	Agent	Lending / Borrowing	30.09.2023 Anzahl/ Nominal
BALOISE LIFE LTD 2.2000 19/06/48	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	995'000
BNP PARIBAS 2.3750 20/11/30	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	300'000
COMMERZBANK AG 4.0000 30/03/27	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	399'000
CREDIT AGRICOLE LONDON 2.1250 29/09/25	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	330'000
DNB BANK ASA 1.1675 03/06/27	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	840'000
MONDELEZ INTERNATIONAL 1.6250 08/03/27	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	100'000
MUENCHENER HYPOTHEKENBN 0.3000 20/12/24	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'000'000
MUNICH RE 3.2500 26/05/49	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'000'000
ORANGE SA 0.6250 22/06/29	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'400'000
SCOTIABANK CHILE 0.3850 22/07/26	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	500'000
SVENSKA HANDELSBANKEN A 4.7500 //	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'200'000
ZURICH INSURANCE CO 1.5000 03/05/52	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'500'000

Ausserbilanzgeschäfte	30.09.2023		30.09.2022	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Währungsrisiko	19'651'616.47	23.58%	29'517'634.84	24.12%
Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten	19'651'616.47	23.58%	29'517'634.84	24.12%
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Netto-Gesamtingagement aus Derivaten	0.00	0.00%	0.00	0.00%

Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapieren

- Volumen der verliehenen Positionen	8'617'271.92	10.34%	23'011'303.66	18.80%
- Kommission Einkommen	32'626.75	0.04%	35'674.45	0.03%

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	653.89	947.78	1'185.39
Anteilklasse BH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	5.02	5.61	3.36
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	81.62	82.17	102.74
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	81.50	82.38	102.55
Anteilklasse BH EUR				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	10.08	13.61	22.24
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	EUR	88.09	87.33	109.43
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	EUR	87.97	87.54	109.23
Anteilklasse EBH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	13.16	12.45	14.79
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	80.42	80.76	99.54
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	80.30	80.96	99.36
Anteilklasse UBH EUR				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	0.67	0.67	0.95
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	EUR	88.50	87.64	109.72
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	EUR	88.38	87.86	109.53
Anteilklasse ZB CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	145.14	148.26	292.85
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	966.98	982.29	1'200.67
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	965.60	984.75	1'198.46
Anteilklasse ZBH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	359.92	468.47	376.91
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	809.17	810.38	1'006.79
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	807.98	812.41	1'004.93
Anteilklasse ZBH DUR CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	119.89	298.70	474.30
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	882.28	849.31	961.70
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	880.98	851.43	959.93

Verwendung des Erfolges

Thesaurierung pro Anteil

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber

Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse BH CHF	Anteilklasse BH EUR	Anteilklasse EBH CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF 2.414	EUR 2.607	CHF 2.704
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF 0.845	EUR 0.912	CHF 0.947
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF 1.569	EUR 1.694	CHF 1.758

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse BH CHF	Anteilklasse BH EUR	Anteilklasse EBH CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF 2.414	EUR 2.607	CHF 2.704
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)	CHF 0.845	EUR 0.912	CHF 0.947
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF 1.569	EUR 1.694	CHF 1.758
Coupon Nr. Ertrag	6	5	3

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber

Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse UBH EUR	Anteilklasse ZB CHF	Anteilklasse ZBH CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	EUR 2.804	CHF 36.478	CHF 30.863
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	EUR 0.981	CHF 12.767	CHF 10.802
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	EUR 1.822	CHF 23.711	CHF 20.061

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse UBH EUR	Anteilklasse ZB CHF	Anteilklasse ZBH CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	EUR 2.804	CHF 36.478	CHF 30.863
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)	EUR 0.981	CHF 12.767	CHF 10.802
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	EUR 1.822	CHF 23.711	CHF 20.061
Coupon Nr. Ertrag	5	12	12

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber

Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse ZBH DUR CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF 32.526
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF 11.384
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF 21.142

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Thesaurierung 2023	Anteilklasse ZBH DUR CHF
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF 32.526
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)	CHF 11.384
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF 21.142
Coupon Nr. Ertrag	9

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

Wechselkurse

Wechselkurse per	30.09.2023
AUSTRALISCHER DOLLAR	0.590417
ENGLISCHES PFUND	1.116613
EURO	0.968550
JAPANISCHER YEN	0.006130
KANADISCHER DOLLAR	0.676645
SCHWEDISCHE KRONE	0.084203
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.914805

Vermögensrechnung per 30. September 2023

	Konsolidierung	
	30.09.2023	30.09.2022
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	3'498'369.96	16'565'882.92
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	656'471'460.34	926'065'673.75
Derivative Finanzinstrumente	-8'944'762.44	13'693'815.79
Sonstige Vermögenswerte	7'828'951.79	9'827'125.32
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	658'854'019.65	966'152'497.78
Andere Verbindlichkeiten	29'476.05	31'524.29
Bankverbindlichkeiten	4'930'509.63	18'343'558.39
Nettofondsvermögen	653'894'033.97	947'777'415.10
	Konsolidierung	
	01.10.2022 -	01.10.2021 -
	30.09.2023	30.09.2022
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	947'777'415.10	1'185'387'410.97
Ablieferung Verrechnungssteuer	-10'859'088.47	-15'527'665.48
Ausgaben von Anteilen	40'444'632.61	267'758'153.63
Rücknahmen von Anteilen	-340'600'485.14	-317'020'293.72
Sonstiges aus Anteilverkehr	10'680'613.92	4'085'913.07
Gesamterfolg	6'450'945.95	-176'906'103.37
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	653'894'033.97	947'777'415.10
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	1'469'066.890	1'491'404.165
Ausgegebene Anteile	62'135.071	338'145.928
Zurückgenommene Anteile	-447'675.944	-360'483.203
Bestand am Ende der Berichtsperiode	1'083'526.017	1'469'066.890
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)		
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)		

Anteilklasse BH CHF		Anteilklasse BH EUR		Anteilklasse EBH CHF		Anteilklasse UBH EUR	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022						
CHF							
5'608'365.74	3'355'314.63	13'613'655.71	22'236'297.68	12'453'094.90	14'785'689.90	666'409.84	954'332.15
-53'878.12	-32'139.39	-129'398.05	-209'143.71	-137'021.02	-35'946.98	-7'121.04	-9'671.80
452'365.73	4'089'038.47	0.00	0.00	834'551.75	495'300.00	0.00	0.00
-1'009'351.56	-1'124'097.49	-3'800'492.07	-2'856'966.47	0.00	0.00	0.00	-22'090.73
32'623.29	630'903.41	207'361.82	-297'872.28	-9'134.62	11'303.86	755.58	-342.68
-12'201.05	-1'310'653.89	188'042.28	-5'258'659.51	21'801.60	-2'803'251.88	13'362.11	-255'817.10
5'017'924.03	5'608'365.74	10'079'169.69	13'613'655.71	13'163'292.61	12'453'094.90	673'406.49	666'409.84
68'082.235	32'718.234	161'275.238	188'299.645	153'816.767	148'816.767	7'867.092	8'059.839
5'481.280	47'632.277	0.000	0.000	10'103.233	5'000.000	0.000	0.000
-11'994.004	-12'268.276	-42'972.886	-27'024.407	0.000	0.000	0.000	-192.747
61'569.511	68'082.235	118'302.352	161'275.238	163'920.000	153'816.767	7'867.092	7'867.092
(CHF)	(CHF)	(EUR)	(EUR)	(CHF)	(CHF)	(EUR)	(EUR)
81.62	82.17	88.09	87.33	80.42	80.76	88.50	87.64
81.50	82.38	87.97	87.54	80.30	80.96	88.38	87.86

	Anteilklasse ZB CHF	
	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	148'263'561.94	292'849'168.28
Ablieferung Verrechnungssteuer	-1'835'380.87	-3'864'527.80
Ausgaben von Anteilen	194'197.00	149'344.70
Rücknahmen von Anteilen	-442'870.05	-103'332'709.54
Sonstiges aus Anteilverkehr	192'737.12	-7'637'806.55
Gesamterfolg	-1'227'710.62	-29'899'907.15
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	145'144'534.52	148'263'561.94
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	150'559.866	244'355.291
Ausgegebene Anteile	200.000	135.000
Zurückgenommene Anteile	-445.000	-93'930.425
Bestand am Ende der Berichtsperiode	150'314.866	150'559.866
Währung Anteilklasse	(CHF)	(CHF)
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	966.98	982.29
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	965.60	984.75

Anteilklasse ZBH CHF		Anteilklasse ZBH DUR CHF	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
CHF	CHF	CHF	CHF
468'474'110.02	376'909'689.84	298'698'216.80	474'296'918.31
-5'842'752.69	-5'048'979.96	-2'853'536.68	-6'327'255.84
34'568'751.35	216'178'683.33	4'394'766.78	46'845'787.13
-143'917'278.55	-31'661'897.14	-191'430'492.91	-178'022'532.35
4'442'123.49	15'704'392.01	5'814'147.24	-4'324'664.67
2'197'986.94	-103'607'778.06	5'269'664.69	-33'770'035.78
359'922'940.56	468'474'110.02	119'892'765.92	298'698'216.80
576'647.458	375'059.650	350'818.234	494'094.739
41'359.794	235'640.156	4'990.764	49'738.495
-172'545.693	-34'052.348	-219'718.361	-193'015.000
445'461.559	576'647.458	136'090.637	350'818.234
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
809.17	810.38	882.28	849.31
807.98	812.41	880.98	851.43

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

	Konsolidierung	
	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	302'819.00	33'171.69
Negativzinsen	-27'551.51	-157'060.05
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	29'561'770.95	33'436'465.30
Sonstige Erträge	14'706.83	16'738.27
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	785'417.08	3'994'805.40
Total Erträge	30'637'162.35	37'324'120.61
Aufwendungen		
Passivzinsen	-39'777.78	37'000.60
Prüfaufwand	14'494.70	17'240.63
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	200'109.69	227'868.49
- die Depotbank	13'410.01	15'092.18
Sonstige Aufwendungen	8'500.29	9'686.46
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	5'870'574.66	3'775'054.40
Total Aufwendungen	6'067'311.57	4'081'942.76
Nettoertrag	24'569'850.78	33'242'177.85
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-26'277'553.10	-34'948'134.94
Realisierter Erfolg	-1'707'702.32	-1'705'957.09
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	8'158'648.27	-175'200'146.28
Gesamterfolg	6'450'945.95	-176'906'103.37
Verwendung des Erfolgs		
Nettoertrag des Rechnungsjahres	24'569'850.78	33'242'177.85
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	24'569'850.78	33'242'177.85
Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)	8'599'447.45	11'634'761.39
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)	15'970'403.33	21'607'416.46

Anteilklasse BH CHF		Anteilklasse BH EUR		Anteilklasse EBH CHF		Anteilklasse UBH EUR	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022						
CHF							
2'131.12	87.32	4'613.01	503.09	5'011.72	447.10	264.76	24.28
-176.99	-443.30	-414.79	-2'710.89	-387.37	-2'098.72	-21.10	-122.45
205'466.65	94'655.33	447'058.97	560'057.79	484'446.05	450'280.21	25'586.73	25'782.42
118.76	42.01	234.83	268.07	290.69	235.50	15.15	12.95
3'080.70	95'828.90	0.00	0.00	12'540.08	403.27	0.00	0.00
210'620.24	190'170.26	451'492.02	558'118.06	501'901.17	449'267.36	25'845.54	25'697.20
-258.76	101.78	-587.96	635.28	-587.30	473.34	-31.64	27.99
102.03	48.92	220.34	288.59	241.87	231.64	12.67	13.34
44'922.47	23'663.88	97'830.93	142'223.62	53'160.60	57'080.74	4'195.69	4'900.25
2'371.62	1'249.32	5'165.01	7'508.75	5'578.61	5'989.98	294.77	344.13
84.48	38.92	184.21	128.00	197.14	197.92	10.45	5.85
14'745.37	16'289.25	50'002.95	24'377.12	0.00	0.00	0.00	59.79
61'967.21	41'392.07	152'815.48	175'161.36	58'590.92	63'973.62	4'481.94	5'351.35
148'653.03	148'778.19	298'676.54	382'956.70	443'310.25	385'293.74	21'363.60	20'345.85
-262'355.59	-265'350.15	-630'552.27	-2'303'638.83	-681'589.55	-582'645.34	-42'319.74	-112'703.46
-113'702.56	-116'571.96	-331'875.73	-1'920'682.13	-238'279.30	-197'351.60	-20'956.14	-92'357.61
101'501.51	-1'194'081.93	519'918.01	-3'337'977.38	260'080.90	-2'605'900.28	34'318.25	-163'459.49
-12'201.05	-1'310'653.89	188'042.28	-5'258'659.51	21'801.60	-2'803'251.88	13'362.11	-255'817.10
148'653.03	148'778.19	298'676.54	382'956.70	443'310.25	385'293.74	21'363.60	20'345.85
148'653.03	148'778.19	298'676.54	382'956.70	443'310.25	385'293.74	21'363.60	20'345.85
52'028.53	52'072.32	104'536.78	134'034.75	155'158.56	134'852.71	7'477.26	7'121.04
96'624.50	96'705.87	194'139.76	248'921.95	288'151.69	250'441.03	13'886.34	13'224.81

	Anteilklasse ZB CHF	
	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	55'931.16	5'394.14
Negativzinsen	-4'549.33	-32'303.15
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	5'426'292.24	6'563'485.23
Sonstige Erträge	3'204.86	2'785.41
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	4'892.81	2'026.69
Total Erträge	5'485'771.74	6'541'388.32
Aufwendungen		
Passivzinsen	-6'854.92	8'701.17
Prüfaufwand	2'700.32	3'469.57
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	0.00	0.00
- die Depotbank	0.00	0.00
Sonstige Aufwendungen	584.56	1'318.47
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	6'189.19	1'283'953.69
Total Aufwendungen	2'619.15	1'297'442.90
Nettoertrag	5'483'152.59	5'243'945.42
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-12'232'797.85	-3'058'103.75
Realisierter Erfolg	-6'749'645.26	2'185'841.67
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5'521'934.64	-32'085'748.82
Gesamterfolg	-1'227'710.62	-29'899'907.15
Verwendung des Erfolgs		
Nettoertrag des Rechnungsjahres	5'483'152.59	5'243'945.42
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'483'152.59	5'243'945.42
Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)	1'919'103.31	1'835'380.87
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)	3'564'049.28	3'408'564.55

Anteilklasse ZBH CHF		Anteilklasse ZBH DUR CHF	
01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
CHF	CHF	CHF	CHF
162'126.88	16'134.39	72'740.35	10'581.37
-14'074.57	-62'392.08	-7'927.36	-56'989.46
15'810'679.31	13'818'157.80	7'162'241.00	11'924'046.52
8'005.81	7'917.33	2'836.73	5'477.00
702'263.50	3'548'986.86	62'639.99	347'559.68
16'669'000.93	17'328'804.30	7'292'530.71	12'230'675.11
-20'613.45	12'261.01	-10'843.75	14'800.03
7'794.58	6'965.74	3'422.89	6'222.83
0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00
6'510.00	5'780.55	929.45	2'216.75
2'927'040.95	432'920.52	2'872'596.20	2'017'454.03
2'920'732.08	457'927.82	2'866'104.79	2'040'693.64
13'748'268.85	16'870'876.48	4'426'425.92	10'189'981.47
-18'728'884.69	-21'932'797.48	6'300'946.59	-6'692'895.93
-4'980'615.84	-5'061'921.00	10'727'372.51	3'497'085.54
7'178'602.78	-98'545'857.06	-5'457'707.82	-37'267'121.32
2'197'986.94	-103'607'778.06	5'269'664.69	-33'770'035.78
13'748'268.85	16'870'876.48	4'426'425.92	10'189'981.47
13'748'268.85	16'870'876.48	4'426'425.92	10'189'981.47
4'811'893.98	5'904'806.42	1'549'249.03	3'566'493.28
8'936'374.87	10'966'070.06	2'877'176.89	6'623'488.19

Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens	
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								
Anleihen								
Australien								
4.875	MACQUARIE BANK (subordinated) T. -2- (reg. -S-) 4.875%/15-10.06.2025	USD	3'000'000		3'000'000			
3.624	MACQUARIE BANK LTD (subordinated) S. -B- 3.624%/20-03.06.2030	USD	900'000		900'000			
3.375	NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH S. -B- 3.375%/16-14.01.2026	USD	3'000'000		3'000'000			
						0.00	0.00	
Belgien								
-	AGEAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-02.07.2049	EUR	5'000'000	400'000	4'600'000	3'821'960.29	0.58	
3.700	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 3.7%/20-02.04.2040	EUR	3'000'000		3'000'000			
1.261	EUROCLEAR BANK SA 1.261%/21-03.08.2026	USD	16'500'000		1'400'000	15'100'000	12'288'541.59	1.87
-	KBC GROUP NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-03.12.2029	EUR	4'000'000	300'000	3'700'000	3'363'886.50	0.51	
1.875	PROXIMUS 0.875%/15-01.10.2025	EUR	5'000'000	400'000	4'600'000	4'271'102.10	0.65	
						23'745'490.48	3.60	
Bermudas								
4.125	ATHENE HOLDING LTD 4.125%/18-12.01.2028	USD	5'000'000		5'000'000			
						0.00	0.00	
Dänemark								
-	DANSKE BANK A/S (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-21.06.2029	EUR	1'000'000	100'000	900'000	853'738.08	0.13	
3.875	DANSKE BANK A/S 3.875%/18-12.09.2023	USD	11'800'000		11'800'000			
						853'738.08	0.13	
Deutschland								
4.125	AMPRION GMBH 4.125%/23-07.09.2034	EUR		3'500'000	3'500'000	3'291'956.17	0.50	
1.000	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1%/15-15.08.2025	EUR		6'600'000	6'600'000			
2.300	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.3%/23-15.02.2033	EUR		11'000'000	11'000'000			
2.600	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.6%/23-15.08.2033	EUR		4'000'000	4'000'000	3'795'398.77	0.58	
-	DEUTSCHE BANK AG FIX-TO-FRN FRN/20-19.11.2030	EUR	4'100'000		400'000	3'700'000	2'836'877.14	0.43
-	DEUTSCHE BANK NY S. -D- FIX-TO-FRN FRN/20-18.09.2031	USD	6'500'000		600'000	5'900'000	4'346'648.40	0.66
1.750	LANXESS AG 1.75%/22-22.03.2028	EUR	1'500'000		1'500'000			
2.500	RWE AG 2.5%/22-24.08.2025	EUR	4'350'000		4'350'000			
5.750	ZF FINANCE GMBH 5.75%/23-03.08.2026	EUR		2'700'000	2'700'000			
						14'270'880.48	2.17	
Frankreich								
0.625	BANQUE FED CRED MUTUEL 0.625%/21-03.11.2028	EUR	7'000'000		600'000	6'400'000	5'111'340.54	0.78
-	BNP PARIBAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-12.08.2035	USD	8'500'000		700'000	7'800'000	5'340'050.91	0.81
3.250	BPCE SA 3.25%/18-11.01.2028	USD	4'000'000		300'000	3'700'000	3'019'527.70	0.46
-	BPCE SA FIX-TO-FRN FRN/21-20.01.2032	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'150'859.87	0.48
4.000	BPCE T. 7 4%/14-15.04.2024	USD	4'000'000		4'000'000			
-	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES (subordinated) FIX-TO-FRN 2.625%/18-29.01.2048	EUR	4'000'000		4'000'000			
4.375	ELECTRICITE DE FRANCE SA 4.375%/22-12.10.2029	EUR		3'800'000	300'000	3'500'000	3'387'619.85	0.51
1.000	FRANCE 1%/14-25.11.2025	EUR		7'500'000	7'500'000			
5.375	FRANCE TELECOM 5.375%/12-13.01.2042	USD		8'500'000	8'500'000			
1.000	SCHLUMBERGER FINANCE FRA 1%/18-18.02.2026	EUR	5'000'000		400'000	4'600'000	4'163'015.80	0.63
2.625	SOCIETE GENERALE 2.625%/20-22.01.2025	USD	5'700'000		5'700'000			
-	SOCIETE GENERALE FIX-TO-FRN FRN/21-09.06.2027	USD		700'000	700'000			
1.488	SOCIETE GENERALE SA 1.488%/20-14.12.2026	USD	6'300'000		500'000	5'800'000	4'736'391.09	0.72
-	SUEZ (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	EUR	300'000	2'200'000	1'600'000	900'000	762'916.18	0.12
0.696	TOTAL CAPITAL INTL SA 0.696%/19-31.05.2028	EUR	3'800'000		300'000	3'500'000	2'953'675.55	0.45
-	TOTALENERGIES SE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-PERPETUAL	EUR	5'300'000		500'000	4'800'000	4'067'584.57	0.62
						36'692'982.06	5.57	
Grossbritannien								
4.875	ANGLO AMERICAN CAPITAL (reg. -S-) 4.875%/15-14.05.2025	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	4'125'582.98	0.63
1.625	ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/17-18.09.2025	EUR	5'850'000		2'150'000	3'700'000	3'422'443.10	0.52
4.500	ANGLO AMERICAN CAPITAL 4.5%/23-15.09.2028	EUR		4'400'000	400'000	4'000'000	3'877'338.10	0.59
2.645	BARCLAYS PLC 2.645%/20-24.06.2031	USD	4'000'000	1'000'000	300'000	4'700'000	3'321'901.92	0.50
-	BARCLAYS PLC FIX-TO-FRN FRN/22-09.08.2028	USD	2'050'000	1'950'000	300'000	3'700'000	3'248'541.86	0.49
-	BP CAPITAL MARKETS PLC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	7'500'000		2'500'000	5'000'000	4'527'971.25	0.69
1.500	BRITISH TELECOMMUNICATIO 1.5%/17-23.06.2027	EUR	5'000'000		400'000	4'600'000	4'064'820.33	0.62
-	BRITISH TELECOMMUNICATIONS STEP UP 00-15.12.2030	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	4'955'631.47	0.75
4.300	HSBC HOLDINGS 4.3%/16-08.03.2026	USD	9'500'000		9'500'000			
-	HSBC HOLDINGS PLC FIX-TO-FRN FRN/19-07.11.2025	USD		9'500'000	800'000	8'700'000	7'622'704.85	1.16
-	HSBC HOLDINGS PLC FRN/18-19.06.2029	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'893'421.89	0.59
1.250	INFORMA PLC 1.25%/19-22.04.2028	EUR	8'573'000		8'573'000			
2.125	INFORMA PLC 2.125%/20-06.10.2025	EUR	2'000'000		2'000'000			

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
- LIBERBANK FIX-TO-FRN 6.875%/17-14.03.2027	USD	6'500'000		6'500'000			
- LLOYDS BANKING GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/22-11.08.2026	USD	9'350'000		800'000	8'550'000	7'607'820.51	1.15
0.550 NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0.55%/21-22.01.2024	USD	4'900'000		4'900'000			
1.750 RECKITT BENCKISER TSY 1.75%/20-19.05.2032	GBP	9'500'000		3'800'000	5'700'000	4'827'301.66	0.73
- ROYAL BK SCOTLND GRP PLC FIX-TO-FRN FRN/19-28.03.2027	GBP	5'000'000		400'000	4'600'000	4'740'093.08	0.72
1.750 ROYALTY PHARMA PLC 1.75%/21-02.09.2027	USD	9'000'000		800'000	8'200'000	6'396'971.09	0.97
4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026	USD	3'000'000		300'000	2'700'000	2'363'419.35	0.36
- SWISS RE FINANCE UK (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-04.06.2052	EUR	2'400'000		2'400'000			
6.150 VODAFONE GROUP 6.15%/07-27.02.2037	USD	8'500'000	4'100'000	5'600'000	7'000'000	6'295'350.87	0.96
						75'291'314.31	11.43
Irland							
- AIB GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/22-04.07.2026	EUR	3'700'000		300'000	3'400'000	3'230'238.22	0.49
- BANK OF IRELAND GROUP FIX-TO-FRN FRN/23-16.07.2028	EUR		450'000	450'000			
4.250 CRH SMW FINANCE DAC 4.25%/23-11.07.2035	EUR		1'000'000		1'000'000	931'909.75	0.14
- ZURICH FINANCE IRELAND (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-19.04.2051	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'220'546.07	0.49
						7'382'694.04	1.12
Italien							
- ENI SPA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	10'000'000		10'000'000			
2.500 INTESA SANPAOLO SPA 2.5%/20-15.01.2030	GBP	3'000'000		300'000	2'700'000	2'371'816.37	0.36
5.125 INTESA SANPAOLO SPA 5.125%/23-29.08.2031	EUR		3'050'000		3'050'000	2'918'776.27	0.44
4.000 REPUBLIC OF ITALY 4%/19-17.10.2049	USD	7'000'000		2'400'000	4'600'000	2'879'563.42	0.44
0.850 UNICREDIT SPA 0.85%/21-19.01.2031	EUR	5'000'000		400'000	4'600'000	3'355'264.47	0.51
						11'525'420.53	1.75
Japan							
4.345 NISSAN MOTOR CO 4.345%/20-17.09.2027	USD	7'000'000		7'000'000			
1.851 NOMURA HOLDINGS INC 1.851%/20-16.07.2025	USD	500'000		500'000			
						0.00	0.00
Kaimaninseln							
4.875 SEAGATE HDD 4.875%/16-01.06.2027	USD	6'500'000		6'500'000			
						0.00	0.00
Kanada							
- BANK OF NOVA SCOTIA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-03.07.2029	CAD	4'000'000		300'000	3'700'000	2'443'175.83	0.37
4.850 BANK OF NOVA SCOTIA S. -I- 4.85%/23-01.02.2030	USD		7'150'000	600'000	6'550'000	5'631'616.71	0.85
5.850 BELL CANADA 5.85%/22-10.11.2032	CAD		5'500'000	500'000	5'000'000	3'371'148.09	0.51
3.550 BELL CANADA THE BELL TELEPHONE CO OF CANADA S. -M-41 3.55%/16-02.03.2026	CAD	6'000'000		6'000'000			
3.630 BROOKFIELD RENEWABLE PAR 3.63%/16-15.01.2027	CAD	5'000'000		400'000	4'600'000	2'914'017.40	0.44
4.200 CANADIAN PACIFIC RAILWAY 4.2%/23-15.11.2069	USD		4'000'000	300'000	3'700'000	2'419'237.10	0.37
3.100 ENBRIDGE INC 3.1%/21-21.09.2033	CAD		5'000'000	400'000	4'600'000	2'443'739.48	0.37
4.550 ENBRIDGE PIPELINES 4.55%/13-17.08.2043	CAD	2'500'000		200'000	2'300'000	1'272'293.34	0.19
5.750 RIO TINTO ALCAN INC 5.75%/05-01.06.2035	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	1'599'703.38	0.24
5.000 ROYAL BANK OF CANADA 5%/23-01.02.2033	USD		9'000'000	800'000	8'200'000	6'983'430.75	1.06
3.631 TORONTO-DOMINION BANK 3.631%/22-13.12.2029	EUR		5'900'000	500'000	5'400'000	4'998'159.66	0.76
2.750 TOTAL CAPITAL CANADA 2.75%/13-15.07.2023	USD	2'000'000		2'000'000			
						34'076'521.74	5.17
Luxemburg							
1.125 CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE S.A. 1.125%/19-17.10.2028	EUR	7'000'000		3'300'000	3'700'000	3'085'151.37	0.47
1.625 CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.625%/19-03.07.2029	EUR	5'000'000		400'000	4'600'000	3'865'266.09	0.59
2.500 JOHN DEERE BANK SA 2.5%/22-14.09.2026	EUR	2'200'000		200'000	2'000'000	1'866'512.08	0.28
						8'816'929.54	1.34
Mexiko							
3.625 AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625%/19-22.04.2029	USD	4'000'000		300'000	3'700'000	3'046'470.54	0.46
4.125 BANCO SANTANDER (MEXICO) - INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANCIERO (reg -S-) 4.125%/12-09.11.2022	USD	5'000'000		5'000'000			
5.375 BANCO SANTANDER MEXICO 5.375%/20-17.04.2025	USD	2'000'000		2'000'000			
2.625 SIGMA ALIMENTOS SA DE CV SIGMA (reg. -S-) 2.625%/17-07.02.2024	EUR	5'000'000		5'000'000			
						3'046'470.54	0.46
Niederlande							
6.650 E.ON INTERNATIONAL FINANCE (reg. -S-) 6.65%/08-30.04.2038	USD	9'744'000		1'800'000	7'944'000	7'322'007.25	1.11
1.875 EASYJET FINCO BV 1.875%/21-03.03.2028	EUR	4'000'000		4'000'000			
3.625 EDP FINANCE BV 3.625%/17-15.07.2024	USD	3'000'000		3'000'000			
- ELM (subordinated) FIX-TO-FRN 4.5%/16-PERPETUAL	EUR	2'000'000		200'000	1'800'000	1'663'873.98	0.25
4.000 ENBW INTL FINANCE BV 4%/23-24.01.2035	EUR		5'400'000	500'000	4'900'000	4'486'199.63	0.68
1.000 ENEL FINANCE INTL NV 1%/20-20.10.2027	GBP	3'300'000		3'300'000			
2.875 ENEL FINANCE INTL NV 2.875%/22-11.04.2029	GBP		3'300'000	300'000	3'000'000	2'876'606.90	0.44
4.750 ENEL FINANCE INTL NV 4.75%/17-25.05.2047	USD	10'500'000		900'000	9'600'000	6'675'121.27	1.01
- IBERDROLA INTL BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	5'700'000		500'000	5'200'000	4'136'092.05	0.63

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens	
-	ING GROEP NV FIX-TO-FRN FRN/22-16.02.2027	EUR	2'000'000	200'000	1'800'000	1'614'849.86	0.25	
-	ING GROUP (subordinated) FIX-TO-FRN 17-26.09.2029	EUR	2'000'000	200'000	1'800'000	1'672'538.63	0.25	
-	ING GROUP NV FIX-TO-FRN FRN/20-26.05.2031	EUR	4'500'000	400'000	4'100'000	3'654'998.73	0.55	
6.250	INNOGY FINANCE 6.25%/02-03.06.2030	GBP	5'000'000	400'000	4'600'000	5'238'017.56	0.80	
8.375	KONINKLUKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030	USD	1'740'000	200'000	1'540'000	1'573'376.02	0.24	
5.350	NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.35%/22-01.03.2026	USD	11'170'000	11'170'000				
3.875	SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875%/18-13.11.2028	USD	8'500'000	700'000	7'800'000	6'743'599.93	1.02	
3.250	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ (reg. -S-) 3.25%/15-27.05.2025	USD	4'950'000	4'950'000				
-	SWISS LIFE RENT (subordinated) FIX-TO-FRN 4.375%/15-PERPETUAL	EUR	5'000'000	400'000	4'600'000	4'340'026.06	0.66	
2.750	TENNET HOLDING BV 2.75%/22-17.05.2042	EUR	10'950'000	5'500'000	5'450'000	4'495'095.27	0.68	
4.750	TENNET HOLDING BV 4.75%/22-28.10.2042	EUR		4'000'000	3'700'000	3'775'180.29	0.57	
1.000	TEVA PHARMACEUTIC FINANCIAL 1%/16-28.07.2025	CHF	2'500'000	300'000	2'500'000	2'376'250.00	0.36	
4.100	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 4.1%/16-01.10.2046	USD		5'200'000	4'900'000	2'812'349.02	0.43	
1.908	UPJOHN FINANCE BV 1.908%/20-23.06.2032	EUR	11'000'000	1'900'000	9'100'000	6'798'264.07	1.03	
-	VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-PERPETUAL	EUR		800'000	800'000	629'782.20	0.10	
						72'884'228.72	11.06	
Norwegen								
4.000	TELENOR ASA 4%/23-03.10.2030	EUR		1'850'000	1'850'000	1'787'785.91	0.27	
						1'787'785.91	0.27	
Österreich								
-	OMV AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	5'300'000	500'000	4'800'000	4'189'947.30	0.64	
-	RAIFFEISEN BANK INTL (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-12.03.2030	EUR	7'200'000	2'000'000	5'200'000	4'385'950.83	0.67	
						8'575'898.13	1.30	
Polen								
-	MBANK SA FIX-TO-FRN FRN/21-21.09.2027	EUR	4'500'000	4'500'000				
						0.00	0.00	
Schweden								
4.125	ELECTROLUX AB 4.125%/22-05.10.2026	EUR	10'000'000	10'000'000				
2.125	ENERGA FINANCE 2.125%/17-07.03.2027	EUR	5'000'000	2'700'000	2'300'000	2'037'801.11	0.31	
5.337	SWEDBANK AB 5.337%/22-20.09.2027	USD	5'000'000	400'000	4'600'000	4'068'815.66	0.62	
2.125	TELE2 AB 2.125%/18-15.05.2028	EUR	3'750'000	300'000	3'450'000	3'057'436.80	0.46	
						9'164'053.57	1.39	
Schweiz								
4.282	CREDIT SUISSE GROUP AG (reg. -S-) 4.282%/17-09.01.2028	USD	4'000'000	4'000'000				
-	UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/23-11.01.2031	EUR		1'800'000	200'000	1'498'137.64	0.23	
4.125	UBS GROUP FUNDING (Jersey) LIMITED (reg. -S-) 4.125%/15-24.09.2025	USD	7'000'000	600'000	6'400'000	5'609'321.99	0.85	
4.253	UBS GROUP FUNDING SWITZE 4.253%/17-23.03.2028	USD	10'500'000	900'000	9'600'000	8'066'561.93	1.22	
						15'174'021.56	2.30	
Singapur								
5.340	PFIZER INVESTMENT ENTER 5.34%/23-19.05.2063	USD		9'000'000	9'000'000			
						0.00	0.00	
Spanien								
2.749	BANCO SANTANDER SA (subordinated) 2.749%/20-03.12.2030	USD	10'000'000	1'800'000	8'200'000	5'597'396.59	0.85	
5.294	BANCO SANTANDER SA 5.294%/22-18.08.2027	USD	3'800'000	3'800'000				
2.629	FCC AQUALIA SA 2.629%/17-08.06.2027	EUR	8'000'000	1'600'000	6'400'000	5'854'938.99	0.89	
1.661	SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 1.661%/19-04.12.2026	EUR	1'810'000	1'810'000				
4.665	TELEFONICA EMISIONES SAU 4.665%/18-06.03.2038	USD		7'300'000	600'000	6'700'000	4'913'836.77	0.75
						16'366'172.35	2.48	
Südkorea								
3.875	KOREA GAS (reg.-S-) 3.875%/14-12.02.2024	USD	3'000'000	3'000'000				
4.000	THE KOREA DEVELOPMENT BANK 4%/22-08.09.2025	USD	6'100'000	500'000	5'600'000	4'974'498.41	0.76	
						4'974'498.41	0.76	
Supranational								
3.750	AFRICA FINANCE CORP 3.75%/19-30.10.2029	USD	5'900'000	1'500'000	4'400'000	3'305'165.55	0.50	
0.800	EUROPEAN UNION 0.8%/22-04.07.2025	EUR		15'000'000	15'000'000			
3.875	INTER-AMERICAN DEVEL BK 3.875%/11-28.10.2041	USD	8'000'000	700'000	7'300'000	5'642'575.16	0.86	
1.100	INTL BK RECON & DEVELOP 1.1%/20-18.11.2030	AUD	10'000'000	690'000	9'310'000	4'215'099.43	0.64	
						13'162'840.14	2.00	
Vereinigte Arabische Emirate								
3.500	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS 3.5%/14-18.06.2024	USD	2'100'000	200'000	1'900'000	1'704'479.68	0.26	
						1'704'479.68	0.26	
Vereinigte Staaten								
4.900	ABBOTT LABORATORIES 4.9%/16-30.11.2046	USD	5'000'000	5'000'000				
3.200	ABBVIE INC 3.2%/20-21.11.2029	USD	8'800'000	8'800'000				
3.250	AIR LEASE CORP 3.25%/19-01.10.2029	USD	6'000'000	6'000'000				

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
5.350 ALLSTATE CORP 5.35%/03-01.06.2033	USD	6'445'000		600'000	5'845'000	5'104'013.56	0.77
1.875 AMERICAN INTL GROUP 1.875%/17-21.06.2027	EUR	2'000'000		2'000'000			
1.650 AMGEN INC 1.65%/21-15.08.2028	USD	8'500'000		8'500'000			
5.750 AMGEN INC 5.75%/23-02.03.2063	USD		6'800'000	600'000	6'200'000	5'237'616.51	0.79
4.750 ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75%/19-23.01.2029	USD	9'500'000		9'500'000			
3.450 APPLE 3.45%/14-06.05.2024	USD	5'000'000		5'000'000			
3.450 APPLE 3.45%/15-09.02.2045	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	1'236'584.26	0.19
4.375 APPLE 4.375%/15-13.05.2045	USD	4'100'000		400'000	3'700'000	2'912'399.43	0.44
4.250 ASHTEAD CAPITAL INC -144A- 4.25%/19-01.11.2029	USD	10'000'000		5'400'000	4'600'000	3'738'016.61	0.57
5.500 ASHTEAD CAPITAL INC 5.5%/22-11.08.2032	USD	600'000		200'000	400'000	338'090.04	0.05
5.550 ASHTEAD CAPITAL INC 5.55%/23-30.05.2033	USD		1'000'000	200'000	800'000	677'746.24	0.10
4.300 AT&T INC 4.3%/23-18.11.2034	EUR		2'450'000	200'000	2'250'000	2'094'748.46	0.32
4.850 AT&T INC 4.85%/17-25.05.2047	CAD		5'000'000	400'000	4'600'000	2'484'607.50	0.38
4.900 AT&T INC 4.9%/18-15.08.2037	USD	11'500'000		1'900'000	9'600'000	7'606'553.97	1.15
- BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2029	EUR	8'500'000		2'600'000	5'900'000	5'521'468.19	0.84
- BANK OF AMERICA CORP S. -N- FIX-TO-FRN FRN/20-29.04.2031	USD	8'350'000		700'000	7'650'000	5'619'322.64	0.85
- BANK OF NY MELLON CORP FIX-TO-FRN FRN/23-01.02.2034	USD		2'400'000	200'000	2'200'000	1'814'333.14	0.28
4.500 BERKSHIRE HATHAWAY 4.5%/13-11.02.2043	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'723'269.52	0.57
1.950 BEST BUY CO INC 1.95%/20-01.10.2030	USD	8'500'000		700'000	7'800'000	5'558'182.55	0.84
2.250 BIOGEN INC 2.25%/20-01.05.2030	USD	600'000		600'000			
3.543 BP CAP MARKETS AMERICA 3.543%/20-06.04.2027	USD	4'000'000		300'000	3'700'000	3'188'123.55	0.48
3.400 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.4%/20-26.07.2029	USD	996'000		996'000			
3.900 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9%/22-15.03.2062	USD	2'750'000		200'000	2'550'000	1'634'653.51	0.25
4.550 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.55%/20-20.02.2048	USD	3'881'000		1'200'000	2'681'000	2'033'689.89	0.31
3.250 CARGILL INC 3.25%/19-23.05.2029	USD	8'500'000		700'000	7'800'000	6'470'953.22	0.98
2.722 CARRIER GLOBAL CORP 2.722%/20-15.02.2030	USD	5'500'000		5'500'000			
5.337 CELANESE US HOLDINGS LLC 5.337%/22-19.01.2029	EUR	5'400'000		4'394'000	1'006'000	959'940.75	0.15
3.700 CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7%/20-01.04.2051	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	956'209.28	0.15
5.600 CHURCH & DWIGHT CO INC 5.6%/22-15.11.2032	USD		1'500'000	1'500'000			
4.800 CIGNA CORP 4.8%/20-15.07.2046	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	1'366'208.50	0.21
4.450 CITIGROUP INC 4.45%/15-29.09.2027	USD	5'000'000		5'000'000			
- CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-08.04.2026	USD		5'000'000	400'000	4'600'000	4'017'350.55	0.61
- CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2031	USD	10'500'000		1'800'000	8'700'000	7'140'799.20	1.08
7.050 COMCAST 7.05%/03-15.03.2033	USD	6'650'000		600'000	6'050'000	6'034'509.27	0.92
3.400 COMCAST CORP 3.4%/20-01.04.2030	USD		3'000'000	300'000	2'700'000	2'174'886.23	0.33
4.150 COMCAST CORP 4.15%/18-15.10.2028	USD	1'500'000		100'000	1'400'000	1'213'053.64	0.18
4.500 CRH AMERICA FINANCE INC 4.5%/18-04.04.2048	USD	6'500'000		600'000	5'900'000	4'140'145.76	0.63
3.250 DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA (reg. -S-) 3.25%/14-01.08.2024	USD	3'000'000		3'000'000			
4.900 DELL INT LLC / EMC CORP 4.9%/21-01.10.2026	USD	4'990'000		400'000	4'590'000	4'098'012.95	0.62
0.750 DOVER CORP 0.75%/19-04.11.2027	EUR	3'000'000		300'000	2'700'000	2'295'024.75	0.35
2.750 ELI LILLY & CO 2.75%/15-01.06.2025	USD	1'500'000		1'500'000			
3.250 EMD FINANCIAL (reg. -S-) 3.25%/15-19.03.2025	USD	7'500'000		600'000	6'900'000	6'084'097.65	0.92
4.200 ENERGY TRANSFER PARTNERS 4.2%/17-15.04.2027	USD	7'000'000		7'000'000			
3.500 EXPRESS SCRIPTS HOLDING 3.5%/14-15.06.2024	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	1'613'584.63	0.24
4.100 FEDEX 4.1%/15-01.02.2045	USD	3'100'000		3'100'000			
4.250 FEDEX CORP 4.25%/20-15.05.2030	USD	1'000'000		100'000	900'000	759'311.18	0.12
4.500 FEDEX CORP 4.5%/15-01.02.2065	USD	3'000'000		300'000	2'700'000	1'727'820.93	0.26
5.905 GE HEALTHCARE HLDG LLC 5.905%/22-22.11.2032	USD		5'300'000	5'300'000			
5.905 GE HEALTHCARE TECH INC 5.905%/23-22.11.2032	USD		5'300'000		5'300'000	4'808'564.64	0.73
4.200 GENERAL MOTORS CO 4.2%/17-01.10.2027	USD	8'284'000		8'284'000			
5.850 GENERAL MOTORS FINL CO 5.85%/23-06.04.2030	USD		2'100'000	100'000	2'000'000	1'751'540.91	0.27
4.625 GLENCORE FUNDING (reg. -S-) 4.625%/14-29.04.2024	USD	5'000'000		5'000'000			
4.000 GOLDMAN SACHS GROUP 4%/14-03.03.2024	USD	9'500'000		3'100'000	6'400'000	5'804'578.01	0.88
4.500 HEALTH CARE REIT 4.5%/14-01.12.2034	GBP	5'000'000		400'000	4'600'000	4'261'430.18	0.65
2.700 HOME DEPOT INC 2.7%/20-15.04.2030	USD	6'500'000		600'000	5'900'000	4'599'784.14	0.70
4.200 HP INC 4.2%/22-15.04.2032	USD	2'000'000		2'000'000			
5.375 INTERPUBLIC GROUP COS 5.375%/23-15.06.2033	USD		4'900'000		4'900'000	4'183'738.97	0.64
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/20-22.04.2031	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'407'175.48	0.52
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/21-04.02.2032	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'187'807.03	0.48
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/21-22.04.2032	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'318'763.22	0.50
4.200 KANSAS CITY SOUTHERN 4.2%/19-15.11.2069	USD	4'000'000		4'000'000			
5.550 KOHL'S CORPORATION 5.55%/15-17.07.2045	USD	5'000'000		5'000'000			
4.450 KROGER 4.45%/17-01.02.2047	USD	3'100'000		300'000	2'800'000	1'997'755.24	0.30
3.150 KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15%/22-15.10.2031	USD	13'000'000		4'000'000	9'000'000	6'219'559.26	0.94
7.300 LASMO (USA) 7.3%/97-15.11.2027	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	4'458'149.43	0.68
5.141 MAGALLANES INC 5.141%/22-15.03.2052	USD	7'500'000		7'500'000			
5.875 METLIFE 5.875%/10-06.02.2041	USD	6'500'000		600'000	5'900'000	5'275'478.47	0.80
5.250 METLIFE INC 5.25%/23-15.01.2054	USD		7'000'000	600'000	6'400'000	5'217'346.26	0.79
4.750 MICROSOFT 4.75%/15-03.11.2055	USD	3'000'000		300'000	2'700'000	2'238'438.66	0.34
4.200 MOLSON COORS BREWING 4.2%/16-15.07.2046	USD	3'250'000	3'000'000	500'000	5'750'000	3'948'253.48	0.60
5.000 MOLSON COORS BREWING 5%/12-01.05.2042	USD	3'250'000		300'000	2'950'000	2'318'189.09	0.35

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
3.875 MORGAN STANLEY S. -F- 3.875%/14-29.04.2024	USD	2'000'000		2'000'000			
- MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/22-17.07.2026	USD	7'000'000		600'000	6'400'000	5'705'691.23	0.87
4.750 NATIONAL FUEL GAS CO 4.75%/18-01.09.2028	USD	2'000'000		2'000'000			
3.625 NETFLIX INC 3.625%/19-15.06.2030	EUR		6'100'000	300'000	5'800'000	5'325'082.09	0.81
3.800 NEW ENGLAND POWER CO -144A- 3.8%/17-05.12.2047	USD	4'000'000		300'000	3'700'000	2'408'845.83	0.37
4.400 NOVARTIS CAPITAL 4.4%/14-06.05.2044	USD	3'600'000		3'600'000			
4.950 NSTAR ELECTRIC CO 4.95%/22-15.09.2052	USD	5'000'000		5'000'000			
4.000 ORACLE 4%/16-15.07.2046	USD	3'000'000		300'000	2'700'000	1'746'765.63	0.27
4.100 ORACLE CORP 4.1%/21-25.03.2061	USD	3'000'000	2'000'000	400'000	4'600'000	2'798'010.36	0.42
2.565 OTIS WORLDWIDE CORP 2.565%/20-15.02.2030	USD	2'650'000		2'650'000			
7.000 OWENS CORNING 7%/06-01.12.2036	USD	3'000'000		300'000	2'700'000	2'608'959.46	0.40
1.125 PARKER-HANNIFIN CORP 1.125%/17-01.03.2025	EUR	6'721'000		721'000	6'000'000	5'563'448.06	0.84
0.750 PEPSICO INC 0.75%/19-18.03.2027	EUR	3'370'000		300'000	3'070'000	2'690'168.06	0.41
4.700 PLAINS ALL AMERICAN 4.7%/14-15.06.2044	USD	8'000'000		700'000	7'300'000	4'931'493.42	0.75
3.100 PRINCIPAL FINANCIAL GROU 3.1%/16-15.11.2026	USD	4'295'000		400'000	3'895'000	3'295'857.50	0.50
1.750 SIMON PROPERTY GROUP LP 1.75%/21-01.02.2028	USD	6'500'000		600'000	5'900'000	4'579'058.32	0.70
7.000 SWISS RE SOLUTIONS 7%/96-15.02.2026	USD	7'500'000		7'500'000			
4.250 SWISS RE TREASURY (US) (reg. -S-) 4.25%/12-06.12.2042	USD	1'187'000		1'187'000			
3.375 T-MOBILE USA INC 3.375%/21-15.04.2029	USD	3'000'000		3'000'000			
4.375 T-MOBILE USA INC 4.375%/21-15.04.2040	USD	3'500'000		3'500'000			
1.250 UNITED STATES OF AMERICA 1.25%/20-15.05.2050	USD	5'800'000		2'300'000	3'500'000	1'511'358.24	0.23
2.000 UNITED STATES OF AMERICA 2%/20-15.02.2050	USD	7'859'000		859'000	7'000'000	3'738'122.73	0.57
2.750 UNITED STATES OF AMERICA 2.75%/12-15.11.2042	USD		7'000'000	3'300'000	3'700'000	2'473'797.65	0.38
2.750 UNITED STATES OF AMERICA 2.75%/18-15.02.2028	USD		6'000'000	6'000'000			
3.000 UNITED STATES OF AMERICA 3%/15-15.05.2045	USD		15'000'000	15'000'000			
3.500 UNITED STATES OF AMERICA 3.5%/09-15.02.2039	USD	10'000'000		5'400'000	4'600'000	3'637'051.07	0.55
4.250 UNITED STATES OF AMERICA 4.25%/10-15.11.2040	USD		7'000'000	600'000	6'400'000	5'447'664.94	0.83
1.375 UNITED STATES OF AMERICA S. -2050- 1.375%/20-15.08.2050	USD	8'000'000		1'700'000	6'300'000	2'814'098.02	0.43
5.750 UNUM 5.75%/12-15.08.2042	USD	4'000'000		4'000'000			
0.850 US BANCORP 0.85%/17-07.06.2024	EUR	5'000'000		5'000'000			
1.875 US TREASURY N/B 1.875%/21-15.02.2041	USD		7'000'000	1'600'000	5'400'000	3'187'038.36	0.48
2.750 US TREASURY N/B 2.75%/22-15.05.2025	USD		6'000'000	6'000'000			
3.000 US TREASURY N/B 3%/22-15.08.2052	USD		5'000'000	400'000	4'600'000	3'067'970.75	0.47
3.375 US TREASURY N/B 3.375%/23-15.05.2033	USD		2'000'000		2'000'000	1'659'513.80	0.25
3.500 US TREASURY N/B 3.5%/23-15.02.2033	USD		12'700'000	9'100'000	3'600'000	3'022'116.14	0.46
3.625 US TREASURY N/B 3.625%/23-15.02.2053	USD		9'000'000	1'800'000	7'200'000	5'451'438.51	0.83
4.000 US TREASURY N/B 4%/22-15.11.2052	USD		8'000'000	700'000	7'300'000	5'918'968.32	0.90
4.125 US TREASURY N/B 4.125%/23-15.08.2053	USD		6'500'000		6'500'000	5'399'923.54	0.82
0.125 US TREASURY N/B S. -BF-2023- 0.125%/21-31.08.2023	USD			9'900'000			
2.750 US TREASURY N/B S. -E-2032- 2.75%/22-15.08.2032	USD	12'000'000		12'000'000			
1.750 VERIZON COMMUNICATIONS 1.75%/20-20.01.2031	USD	5'000'000		400'000	4'600'000	3'170'343.39	0.48
4.862 VERIZON COMMUNICATIONS 4.862%/15-21.08.2046	USD		4'000'000	300'000	3'700'000	2'799'077.02	0.42
2.950 VF CORP 2.95%/20-23.04.2030	USD	10'500'000		1'800'000	8'700'000	6'266'842.80	0.95
4.750 WALT DISNEY COMPANY/THE 4.75%/19-15.09.2044	USD	4'000'000		4'000'000			
4.279 WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.279%/22-15.03.2032	USD		4'250'000	4'250'000			
4.279 WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.279%/23-15.03.2032	USD		4'250'000	400'000	3'850'000	2'989'050.96	0.45
5.141 WARNERMEDIA HOLDINGS INC 5.141%/23-15.03.2052	USD		7'500'000	600'000	6'900'000	4'683'051.54	0.71
2.000 WELLS FARGO & COMPANY 2%/15-27.04.2026	EUR	2'500'000		200'000	2'300'000	2'108'819.07	0.32
- WELLS FARGO & COMPANY S. -U- FIX-TO-FRN FRN/22-15.08.2026	USD	700'000		700'000			
4.125 WI TREAS. NT/BD S. -AD-2027- 4.125%/22-30.09.2027	USD	14'000'000		14'000'000			
3.875 WI TREAS. NT/BD S. -E-2033- 3.875%/23-15.08.2033	USD		6'000'000		6'000'000	5'186'087.82	0.79
0.500 WI TREASURY N/B 0.5%/20-31.10.2027	USD	12'000'000		12'000'000			
0.625 WI TREASURY N/B 0.625%/20-31.12.2027	USD		9'500'000	9'500'000			
1.625 WI TREASURY N/B 1.625%/20-15.11.2050	USD	5'000'000		2'300'000	2'700'000	1'294'034.83	0.20
1.875 WI TREASURY N/B 1.875%/21-15.02.2051	USD	2'000'000		200'000	1'800'000	923'410.08	0.14
4.625 WI TREASURY N/B 4.625%/23-28.02.2025	USD		6'000'000	6'000'000			
Total Anleihen						296'975'040.07	45.07
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						656'471'460.34	99.64
Derivative Finanzinstrumente							
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Financial Futures							
Deutschland							
EURO BOBL Commodities -100000- 12/22	EUR	-632	632				
EURO BOBL Commodities -100000- 03/23	EUR		408	408			
EURO BOBL Commodities -100000- 06/23	EUR		92	92			
EURO BUND Commodities -100000- 06/23	EUR		261	261			

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens	
EURO BUND Commodities -100000- 09/23	EUR		32	32		0.00	0.00	
Vereinigte Staaten								
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 03/23	USD		425	425				
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 06/23	USD		348	348				
US TREASURY NOTES 30 YEARS -100000- 03/23	USD		131	131				
US TREASURY NOTES 30 YEARS -100000- 06/23	USD		76	76				
							0.00	0.00
Total Financial Futures							0.00	0.00
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							0.00	0.00
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								
Devisentermingeschäfte								
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-17'740'270.46	-2.69	
Total Devisentermingeschäfte						-17'740'270.46	-2.69	
Swaps								
Floating Swap ~ 15.06.2020 ~ 17.06.2030	GBP	2'000'000		2'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 18.12.2020 ~ 22.12.2030	EUR	5'000'000		5'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 28.05.2021 ~ 01.06.2028	EUR	7'000'000		7'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 28.05.2021 ~ 28.05.2031	GBP	3'000'000		3'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 20.08.2021 ~ 24.08.2041	USD	20'000'000		20'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 23.08.2021 ~ 25.08.2028	USD	20'000'000		20'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 27.09.2021 ~ 29.09.2046	USD	9'000'000		9'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 29.12.2021 ~ 31.12.2051	USD	6'000'000		6'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 29.12.2021 ~ 31.12.2036	USD	10'000'000		10'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 30.12.2021 ~ 03.01.2028	USD	20'000'000		20'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 30.12.2021 ~ 03.01.2032	USD	37'000'000		37'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 12.10.2021 ~ 14.10.2046	USD	3'000'000		3'000'000		0.00	0.00	
Floating Swap ~ 13.12.2022 ~ 15.12.2029	EUR		10'000'000		10'000'000	317'159.45	0.05	
Floating Swap ~ 04.01.2023 ~ 06.01.2043	USD		16'000'000		16'000'000	1'963'517.74	0.30	
Floating Swap ~ 16.12.2022 ~ 20.12.2032	USD		23'000'000		23'000'000	1'960'794.37	0.30	
Floating Swap ~ 30.12.2021 ~ 03.01.2028	USD		10'000'000		10'000'000	1'400'771.67	0.21	
Floating Swap ~ 26.04.2023 ~ 28.04.2033	USD		4'000'000		4'000'000	364'893.84	0.06	
Floating Swap ~ 29.12.2021 ~ 31.12.2051	USD		4'000'000		4'000'000	1'630'673.19	0.25	
Floating Swap ~ 15.06.2020 ~ 17.06.2030	GBP		1'500'000		1'500'000	433'040.34	0.07	
Floating Swap ~ 06.04.2023 ~ 12.04.2033	EUR		1'000'000		1'000'000	44'566.86	0.01	
Floating Swap ~ 28.05.2021 ~ 01.06.2028	EUR		3'000'000		3'000'000	471'904.68	0.07	
Floating Swap ~ 20.06.2023 ~ 22.06.2053	USD		1'500'000		1'500'000	208'185.88	0.03	
Total Swaps						8'795'508.02	1.33	
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						-8'944'762.44	-1.36	
Total Derivative Finanzinstrumente						-8'944'762.44	-1.36	
Total Anlagen						647'526'697.90	98.28	
Bankguthaben auf Sicht						3'498'369.96	0.53	
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00	
Sonstige Vermögenswerte						7'828'951.79	1.19	
Gesamtfondsvermögen (GFV)						658'854'019.58	100.00	
./. Bankverbindlichkeiten						4'930'509.63	0.75	
./. Andere Verbindlichkeiten						29'476.05	0.00	
./. Andere Kredite						0.00	0.00	
Nettofondsvermögen						653'894'033.90	99.25	

(1) Umfassen auch Corporate Actions

Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	0.00	0.00
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	647'526'697.90	98.28
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
09.11.2022	Bought	CAD	27'465'000	CHF	20'248'104	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CAD	1'278'000	CHF	924'937	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CAD	25'000	EUR	18'519	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'006'863	AUD	1'517'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'822'575	AUD	2'746'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'875'673	AUD	2'826'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	10'029'318	CAD	13'604'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	17'383'954	CAD	23'580'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	5'603'985	CAD	7'787'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	111'925'814	EUR	114'795'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	65'974'756	EUR	67'666'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	6'069'412	EUR	6'225'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	399'783	EUR	416'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	712'114	EUR	741'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	2'148'055	EUR	2'232'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	65'000	EUR	67'550	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	133'756	EUR	137'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	416'890	EUR	427'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	976'324	EUR	1'000'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	480'068	EUR	489'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	15'000	EUR	15'279	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	30'000	EUR	30'342	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'592'838	EUR	1'611'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	978'839	EUR	990'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	3'971'492	EUR	4'018'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	21'197'334	GBP	18'411'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'934'252	GBP	1'680'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	12'829'389	GBP	11'143'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	263'591	GBP	232'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	321'231	GBP	279'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'249'231	GBP	1'085'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	4'020'476	JPY	566'288'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	2'302'667	JPY	324'333'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	7'414'880	USD	7'806'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	211'829'435	USD	223'003'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	341'179'487	USD	359'176'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	2'459'886	USD	2'610'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'048'043	USD	1'112'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	14'681'982	USD	15'000'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	659'201	USD	673'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'974'666	USD	2'016'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	7'794'213	USD	7'821'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'554'109	USD	1'551'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	632'988	USD	633'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	CHF	1'197'157	USD	1'182'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	59'100	AUD	87'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	554'934	CAD	735'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	71'713	CHF	70'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	90'528	CHF	87'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	3'674'000	CHF	3'575'518	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	1'823'000	CHF	1'774'134	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	2'013'000	CHF	1'937'292	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	746'000	CHF	717'943	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	4'750'000	CHF	4'637'620	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	2'267'000	CHF	2'240'759	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	679'252	GBP	575'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	17'468	GBP	15'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	128'763	JPY	17'684'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	10'917'420	USD	11'196'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	EUR	21'068	USD	21'000	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	GBP	8'000'000	CHF	9'029'088	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	GBP	946'000	CHF	1'033'433	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	GBP	2'102'000	CHF	2'296'275	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	GBP	579'000	CHF	654'839	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	GBP	90'000	EUR	102'162	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	JPY	1'088'929'000	CHF	7'731'070	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	12'261'000	CHF	12'021'660	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	5'384'000	CHF	5'278'902	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	9'225'000	CHF	9'044'924	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
09.11.2022	Bought	USD	16'052'000	CHF	15'997'022	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	7'274'000	CHF	7'273'857	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	3'766'000	CHF	3'814'291	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	4'000	EUR	3'922	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	278'000	EUR	278'969	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	518'000	EUR	527'654	0.00	0.00
09.11.2022	Bought	USD	495'000	EUR	505'226	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	AUD	42'000	CHF	26'719	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CAD	17'118'000	CHF	12'501'104	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CAD	1'477'000	CHF	1'046'892	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CAD	89'000	CHF	62'271	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'807'040	AUD	2'826'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'656'133	AUD	2'590'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	866'433	AUD	1'355'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	136'777	AUD	215'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	16'259'907	CAD	22'265'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	8'511'530	CAD	11'655'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	903'715	CAD	1'275'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	896'822	CAD	1'283'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	141'334	CAD	202'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	105'042'999	EUR	106'416'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	15'006'848	EUR	15'203'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	57'347'421	EUR	58'097'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	492'621	EUR	500'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	2'930'451	EUR	2'993'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	2'048'281	EUR	2'092'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	17'000	EUR	17'337	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	910'838	EUR	926'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	18'000	EUR	18'385	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	150'777	EUR	154'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	2'344'874	EUR	2'395'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	18'409'621	GBP	16'276'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	11'007'768	GBP	9'732'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'094'205	GBP	977'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'274'345	GBP	1'119'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	143'899	GBP	127'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	760'285	GBP	671'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	3'830'953	JPY	566'288'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	2'072'892	JPY	306'413'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	41'572	JPY	6'099'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	248'269	JPY	36'423'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	322'118'939	USD	327'017'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	17'771'767	USD	18'042'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	196'437'027	USD	199'424'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'053'650	USD	1'100'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	7'024'094	USD	7'461'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	380'896	USD	405'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'459'813	USD	1'536'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	1'875'138	USD	1'973'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	CHF	10'451'218	USD	11'026'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	49'225	AUD	76'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	6'497	AUD	10'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	483'931	CAD	654'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	18'580	CAD	26'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	71'951	CHF	71'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	7'262'000	CHF	7'110'237	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	2'122'000	CHF	2'080'748	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	337'000	CHF	330'449	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	3'365'000	CHF	3'309'902	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	5'624'000	CHF	5'531'913	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	547'982	GBP	478'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	27'773	GBP	24'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	117'973	JPY	17'210'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	8'897	JPY	1'278'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	9'591'403	USD	9'614'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	194'215	USD	202'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	EUR	332'072	USD	343'000	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	GBP	4'553'000	CHF	5'149'853	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	GBP	1'102'000	CHF	1'234'200	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
15.12.2022	Bought	GBP	583'000	CHF	663'935	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	JPY	1'088'929'000	CHF	7'366'633	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	JPY	30'388'000	CHF	205'598	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	22'912'000	CHF	21'570'305	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	22'796'000	CHF	21'461'098	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	3'329'000	CHF	3'130'874	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	13'654'000	CHF	12'976'752	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	413'000	CHF	391'470	0.00	0.00
15.12.2022	Bought	USD	81'000	EUR	77'690	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	AUD	9'000	EUR	5'840	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CAD	16'371'000	CHF	11'118'496	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CAD	25'000	EUR	17'158	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CAD	48'000	EUR	33'045	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'500'785	AUD	2'369'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'992'389	AUD	3'145'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	831'799	AUD	1'313'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	7'491'792	CAD	11'031'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	15'910'634	CAD	23'427'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	256'615	CAD	373'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	26'802'628	EUR	27'289'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	108'930'305	EUR	110'907'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	53'408'821	EUR	54'378'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'005'616	EUR	1'024'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'171'745	EUR	1'169'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	87'000	EUR	86'851	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'532'786	EUR	1'530'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	3'489'343	EUR	3'483'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'721'370	EUR	1'727'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	260'149	EUR	261'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	10'355'730	GBP	9'074'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	19'316'848	GBP	16'926'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	204'627	GBP	181'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'713'113	JPY	249'901'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	3'641'299	JPY	531'176'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	172'179'115	USD	187'494'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	319'572'827	USD	347'998'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	3'262'720	USD	3'541'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'124'412	USD	1'215'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	568'221	USD	614'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	749'168	USD	815'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	3'217'288	USD	3'500'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	1'126'051	USD	1'225'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	9'011'788	USD	9'826'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	661'256	USD	721'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	CHF	907'715	USD	1'000'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	61'260	AUD	95'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	492'380	CAD	712'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	75'328	CHF	74'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	1'762'000	CHF	1'736'134	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	3'158'000	CHF	3'118'762	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	114'720	CHF	115'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	597'059	GBP	514'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	18'147	GBP	16'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	112'570	JPY	16'129'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	9'904'432	USD	10'589'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	EUR	253'961	USD	276'000	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	GBP	3'737'000	CHF	4'264'862	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	GBP	17'000	EUR	19'468	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	GBP	31'000	EUR	34'919	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	JPY	952'351'000	CHF	6'528'524	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	JPY	1'491'000	EUR	10'559	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	USD	18'757'000	CHF	17'224'891	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	USD	10'877'000	CHF	10'050'663	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	USD	410'000	EUR	378'544	0.00	0.00
16.02.2023	Bought	USD	347'000	EUR	320'945	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CAD	16'371'000	CHF	11'185'568	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CAD	942'000	CHF	643'895	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CAD	888'000	CHF	590'931	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CAD	1'055'000	CHF	710'429	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
28.04.2023	Bought	CHF	2'000'902	AUD	3'145'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	835'353	AUD	1'313'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'507'198	AUD	2'369'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	7'791'840	CAD	11'404'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	16'006'615	CAD	23'427'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'333'317	CAD	1'980'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	31'000	EUR	31'261	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	55'688'570	EUR	56'600'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	111'140'021	EUR	112'959'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	26'849'565	EUR	27'289'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	590'787	EUR	600'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	615'919	EUR	631'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	2'000'000	EUR	2'046'097	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'950'548	EUR	2'000'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	32'000	EUR	32'153	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	129'009	EUR	130'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	227'254	EUR	229'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	855'441	EUR	861'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	11'000	EUR	11'148	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	4'243'679	EUR	4'300'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	363'180	EUR	368'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	10'299'436	GBP	9'255'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	18'836'116	GBP	16'926'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	397'420	GBP	352'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'559'291	GBP	1'394'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	988'007	GBP	876'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'739'355	JPY	249'901'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	3'697'079	JPY	531'176'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	166'061'805	USD	182'308'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	328'159'434	USD	360'264'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'496'065	USD	1'630'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	10'193'412	USD	11'062'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	4'269'726	USD	4'706'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	3'493'928	USD	3'840'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	828'898	USD	911'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	1'920'813	USD	2'100'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	3'168'089	USD	3'481'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	3'807'978	USD	4'190'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	426'239	USD	469'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	CHF	220'251	USD	244'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	55'611	AUD	86'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	443'752	CAD	639'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	103'673	CHF	102'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	8'755'000	CHF	8'636'991	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	5'293'000	CHF	5'221'656	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	421'000	CHF	418'153	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	1'787'000	CHF	1'774'915	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	5'519'000	CHF	5'481'675	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	6'031'000	CHF	5'943'731	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	4'246'000	CHF	4'184'560	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	654'000	CHF	650'979	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	14'068	CHF	14'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	3'798'000	CHF	3'779'499	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	819'000	CHF	815'010	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	2'759'000	CHF	2'722'863	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	545'100	GBP	482'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	103'560	JPY	14'638'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	9'355'389	USD	10'108'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	94'413	USD	103'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	EUR	116'174	USD	127'000	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	3'737'000	CHF	4'158'724	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	609'000	CHF	674'166	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	1'037'000	CHF	1'159'960	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	1'009'000	CHF	1'138'013	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	432'000	CHF	487'237	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	GBP	18'000	EUR	20'345	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	JPY	952'351'000	CHF	6'628'532	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	JPY	33'275'000	CHF	233'933	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	14'257'000	CHF	12'986'502	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
28.04.2023	Bought	USD	18'687'000	CHF	17'219'697	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	7'955'000	CHF	7'394'941	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	1'289'000	CHF	1'169'502	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	1'000'000	CHF	922'495	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	5'655'000	CHF	5'145'354	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	19'836'000	CHF	18'143'454	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	2'065'000	CHF	1'892'133	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	12'913'000	CHF	11'764'342	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	2'305'000	CHF	2'099'962	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	4'000'000	CHF	3'610'668	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	9'732'000	CHF	8'784'755	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	17'000	EUR	15'803	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	323'000	EUR	303'174	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	204'000	EUR	192'948	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	102'000	EUR	93'451	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	40'000	EUR	36'823	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	28'000	EUR	25'614	0.00	0.00
28.04.2023	Bought	USD	147'000	EUR	133'918	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	AUD	700'000	CHF	417'288	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	AUD	273'000	CHF	162'742	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CAD	14'391'000	CHF	9'341'903	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CAD	352'000	CHF	228'942	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CAD	1'210'000	CHF	815'017	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CAD	2'278'000	CHF	1'534'388	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CAD	22'000	EUR	15'185	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	1'386'088	AUD	2'369'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	1'840'121	AUD	3'145'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	721'421	AUD	1'233'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	15'207'614	CAD	23'427'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	5'735'231	CAD	8'835'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	1'145'066	CAD	1'700'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	180'688	CAD	268'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	2'000'000	EUR	2'041'879	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	42'111'214	EUR	42'993'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	108'670'498	EUR	110'946'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	13'957'732	EUR	14'250'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	2'478'641	EUR	2'547'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	34'000	EUR	34'942	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	214'949	EUR	221'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	12'000	EUR	12'308	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	200'713	EUR	206'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	391'682	EUR	402'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	7'472'389	GBP	6'772'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	18'502'219	GBP	16'768'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	120'843	GBP	107'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	1'386'759	JPY	208'196'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	3'538'076	JPY	531'176'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	119'786'625	USD	135'552'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	312'773'241	USD	353'938'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	9'479'498	USD	10'739'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	2'841'143	USD	3'118'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	425'694	USD	467'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	816'876	USD	900'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	629'498	USD	696'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	1'636'152	USD	1'809'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	CHF	2'724'549	USD	3'000'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	51'374	AUD	86'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	423'549	CAD	639'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	1'000'000	CHF	973'921	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	57'173	CHF	56'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	33'907	CHF	33'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	1'674'000	CHF	1'629'071	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	714'000	CHF	694'450	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	2'300'000	CHF	2'242'463	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	10'131'000	CHF	9'877'563	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	5'343'000	CHF	5'209'340	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	17'518	CHF	17'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	1'018'000	CHF	987'863	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	7'436'000	CHF	7'215'865	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
16.06.2023	Bought	EUR	515'942	GBP	458'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	19'786	GBP	17'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	99'546	JPY	14'638'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	9'526	JPY	1'419'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	8'716'671	USD	9'661'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	74'016	USD	79'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	17'687	USD	19'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	EUR	22'278	USD	24'000	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	87'000	CHF	98'440	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	1'467'000	CHF	1'618'723	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	251'000	CHF	278'738	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	245'000	CHF	277'183	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	200'000	CHF	227'296	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	763'000	CHF	867'134	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	1'493'000	CHF	1'696'765	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	GBP	26'000	EUR	30'234	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	JPY	952'351'000	CHF	6'343'454	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	JPY	45'615'000	CHF	298'571	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	4'560'000	CHF	4'029'649	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	3'758'000	CHF	3'317'250	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	500'000	CHF	450'202	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	12'795'000	CHF	11'520'669	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	608'000	CHF	547'446	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	17'950'000	CHF	16'292'138	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	32'587'000	CHF	29'577'265	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	21'249'000	CHF	19'134'852	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	2'011'000	CHF	1'810'918	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	4'000	EUR	3'628	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	458'000	EUR	426'490	0.00	0.00
16.06.2023	Bought	USD	105'000	EUR	97'439	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CAD	10'998'000	CHF	7'423'881	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CAD	229'000	CHF	154'565	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CAD	3'269'000	CHF	2'206'431	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CAD	170'000	CHF	112'007	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CAD	47'000	EUR	31'844	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	585'196	AUD	960'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'917'126	AUD	3'145'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'188'069	AUD	1'949'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	4'369'411	CAD	6'473'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	14'996'942	CAD	22'217'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'079'930	CAD	1'600'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	97'371'774	EUR	100'206'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	13'531'145	EUR	13'925'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	29'922'051	EUR	30'793'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	13'000	EUR	13'594	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'434'386	EUR	1'500'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	17'875'194	GBP	15'760'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	5'725'506	GBP	5'048'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'252'283	GBP	1'100'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	222'917	GBP	200'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'052'397	JPY	162'581'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	3'438'335	JPY	531'176'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	88'584'714	USD	98'864'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	283'589'541	USD	316'497'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	2'769'273	USD	3'100'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	CHF	1'067'822	USD	1'247'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	53'959	AUD	86'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	428'603	CAD	617'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	61'741	CHF	60'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	5'900'000	CHF	5'765'102	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	7'521'000	CHF	7'349'040	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	249'000	CHF	239'149	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	86'000	CHF	82'238	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	360'000	CHF	344'253	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	524'163	GBP	449'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	106'970	JPY	16'057'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	EUR	8'497'910	USD	9'216'000	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	GBP	378'000	CHF	428'732	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	GBP	2'396'000	CHF	2'727'700	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
25.08.2023	Bought	GBP	279'000	CHF	317'624	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	GBP	22'000	EUR	25'288	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	GBP	27'000	EUR	31'456	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	JPY	749'803'000	CHF	4'853'521	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	JPY	22'675'000	CHF	144'641	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	JPY	100'001'000	CHF	637'892	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	JPY	3'087'000	EUR	19'820	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	1'000'000	CHF	866'831	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	5'376'000	CHF	4'817'036	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	24'357'000	CHF	21'758'449	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	848'000	CHF	735'072	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	580'000	CHF	502'762	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	405'000	EUR	370'566	0.00	0.00
25.08.2023	Bought	USD	116'000	EUR	105'155	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CAD	9'398'000	CHF	6'054'868	280'380.88	0.04
08.11.2023	Bought	CAD	416'000	CHF	280'540	-112.28	0.00
08.11.2023	Bought	CAD	37'000	EUR	25'904	-83.99	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	539'843	AUD	960'000	-25'379.46	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'768'547	AUD	3'145'000	-83'144.18	-0.01
08.11.2023	Bought	CHF	1'095'993	AUD	1'949'000	-51'525.60	-0.01
08.11.2023	Bought	CHF	12'207'666	CAD	18'948'000	-567'425.84	-0.09
08.11.2023	Bought	CHF	3'913'308	CAD	6'074'000	-181'894.90	-0.03
08.11.2023	Bought	CHF	119'365	CAD	177'000	47.95	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	28'612'862	EUR	30'184'000	-549'467.58	-0.08
08.11.2023	Bought	CHF	9'029'205	EUR	9'525'000	-173'392.48	-0.03
08.11.2023	Bought	CHF	87'779'037	EUR	92'599'000	-1'685'666.18	-0.26
08.11.2023	Bought	CHF	2'856'162	EUR	3'000'000	-42'262.64	-0.01
08.11.2023	Bought	CHF	1'988'531	EUR	2'082'000	-22'959.94	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'584'521	EUR	1'659'000	-18'295.17	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	12'416	EUR	13'000	-143.36	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	289'914	EUR	301'000	-866.27	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'662'430	EUR	1'726'000	-5'082.09	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	5'262'472	GBP	4'769'000	-41'527.58	-0.01
08.11.2023	Bought	CHF	14'967'535	GBP	13'564'000	-1'18'112.85	-0.02
08.11.2023	Bought	CHF	796'709	GBP	722'000	-6'287.04	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	420'346	GBP	378'000	-45.92	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	850'954	JPY	139'906'000	-8'539.26	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	2'622'547	JPY	431'175'000	-26'317.06	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	85'905'622	USD	98'284'000	-3'639'969.83	-0.55
08.11.2023	Bought	CHF	255'695'176	USD	292'539'000	-10'834'247.00	-1.64
08.11.2023	Bought	CHF	180'822	USD	206'000	-6'859.68	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	3'849'043	USD	4'385'000	-146'017.91	-0.02
08.11.2023	Bought	CHF	1'477'809	USD	1'628'000	-5'212.91	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	51'014	AUD	86'000	-1'346.74	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	387'389	CAD	570'000	-10'019.45	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	49'585	CHF	47'000	903.92	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	1'291'000	CHF	1'243'451	3'791.67	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	465'647	GBP	400'000	5'025.29	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	83'227	JPY	12'970'000	723.55	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	8'017'364	USD	8'695'000	-175'686.45	-0.03
08.11.2023	Bought	GBP	471'000	CHF	523'765	56.99	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	1'794'000	CHF	1'989'803	5'390.97	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	203'000	CHF	225'156	610.01	0.00
08.11.2023	Bought	JPY	749'803'000	CHF	4'560'546	45'862.64	0.01
08.11.2023	Bought	USD	3'276'000	CHF	2'863'404	120'813.90	0.02
08.11.2023	Bought	USD	5'876'000	CHF	5'157'806	194'839.22	0.03
08.11.2023	Bought	USD	4'153'000	CHF	3'769'865	13'241.75	0.00
08.11.2023	Bought	USD	3'459'000	CHF	3'139'890	11'028.94	0.00
08.11.2023	Bought	USD	207'000	EUR	190'233	4'789.69	0.00
08.11.2023	Bought	USD	295'000	EUR	278'015	133.81	0.00
Total Devisentermingeschäfte						-17'740'270.46	-2.69

Ausserbilanzgeschäfte	30.09.2023		30.09.2022	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
Engagement erhöhende Derivatpositionen:				
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	0.00	0.00%	0.00	0.00%
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Total engagement erhöhende Positionen	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Engagement reduzierende Derivatpositionen:				
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	68'750'722.93	10.51%	199'130'443.74	21.01%
- Währungsrisiko	517'287'886.62	79.11%	785'245'415.82	82.85%
Total engagement reduzierende Positionen	586'038'609.55	89.62%	984'375'859.56	103.86%

Erläuterungen zum Jahresbericht per 30. September 2023

Erläuterung 1: Angaben über Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

Am 19. März 2023 haben die Credit Suisse Group AG und die UBS Group AG eine Vereinbarung zum Zusammenschluss unterzeichnet, welche per 12. Juni 2023 vollzogen wurde. Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen mit konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG bzw. der UBS Group AG. Diese Beziehungen und Dienstleister können in Zukunft ändern.

Erläuterung 2: Verkaufsrestriktionen USA

Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen innerhalb der USA und ihren Territorien weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden. Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen Bürgern der USA oder Personen mit Wohnsitz oder Sitz in den USA und/oder anderen natürlichen wie juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Erträge, ungeachtet der Herkunft, der US-Einkommenssteuer unterliegen sowie Personen, die gemäss Bestimmung S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils gültigen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Erläuterung 3: Kennzahlen und technische Daten

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Währung	Depotbankkommission	Verwaltungs- ¹ kommission	Total Expense ² Ratio (TER)
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	A	277 020	CHF	0.04%	0.97%	1.04%
	EA	23 723 966	CHF	0.04%	0.37%	0.44%
	IA	20 191 423	CHF	0.04%	0.42%	0.49%
	UA	26 422 906	CHF	0.04%	0.62%	0.69%
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	BH CHF	39 364 170	CHF	0.04%	0.80%	0.85%
	BH EUR	41 217 488	EUR	0.04%	0.80%	0.85%
	EBH CHF	111 963 421	CHF	0.04%	0.40%	0.45%
	UBH EUR	41 217 489	EUR	0.04%	0.60%	0.65%
	ZB CHF	12 648 038	CHF	0.00%	0.00%	0.00%
	ZBH CHF	12 648 039	CHF	0.00%	0.00%	0.00%
	ZBH DUR CHF	21 698 345	CHF	0.00%	0.00%	0.00%

¹ Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

² Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens. Allfällige Rückvergütungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER.

Erläuterung 4: Fondsperformance

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungsdatum	Währung	kum. Seit Lancierung	2022 ¹	2021 ¹	2020 ¹
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	A	277 020	27.01.2014	CHF	-	-9.9%	-0.9%	1.1%
	EA	23 723 966	08.05.2014	CHF	-	-9.4%	-0.3%	1.7%
	IA	20 191 423	27.01.2014	CHF	-	-9.4%	-0.4%	1.7%
	UA	26 422 906	27.02.2015	CHF	-	-9.6%	-0.6%	1.4%
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	BH CHF	39 364 170	15.12.2017	CHF	-	-16.9%	-2.0%	7.8%
	BH EUR	41 217 488	11.06.2018	EUR	-	-16.8%	-1.7%	8.1%
	EBH CHF	111 963 421	18.06.2021	CHF	-18.5%	-16.3%	-	-
	UBH EUR	41 217 489	11.06.2018	EUR	-	-16.6%	-1.5%	8.3%
	ZB CHF	12 648 038	06.01.2014	CHF	-	-14.7%	0.9%	2.9%
	ZBH CHF	12 648 039	06.01.2014	CHF	-	-16.1%	-1.1%	8.7%
	ZBH DUR CHF	21 698 345	24.04.2014	CHF	-	-7.6%	0.9%	4.7%

¹ Die Fondsperformance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Börsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Erläuterung 5: Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften

Fondsname	Vertragspartner
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	CITIBANK N.A. LONDON CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG JP MORGAN SECURITIES PLC LONDON UBS AG LONDON BRANCH

Erläuterung 6: Entgegengenommene Sicherheiten

Fondsname	Sicherheit	Wert in Fondswährung
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	Collaterals Sec Lending - Equities	3'352'455.64
	Collaterals Sec Lending - Floating Rate Bonds	83'768.06
	Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds	5'536'419.04

Erläuterung 7: Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihen

Principle Borrower Setup mit der Credit Suisse (Schweiz) AG als Borgerin und der Credit Suisse Funds AG, handelnd für die Teilvermögen welche Erträge aus Effektenleihe erwirtschaften, als Verleiherin. Die bis zum 30. April 2023 erwirtschafteten Erträge aus Wertschriftenleihe sind zu 60% dem Fonds gutgeschrieben. Die ab dem 1. Mai 2023 erwirtschafteten Erträge aus Wertschriftenleihe werden zu mindestens 80% dem Fonds gutgeschrieben.

Erläuterung 8: Zusammensetzung des Portefeuilles

Die Zusammensetzung des Portefeuilles weist Bestandesveränderungen ohne Fraktionen aus. Dies kann zu Rundungsdifferenzen in der Totalisierung führen.

Erläuterung 9: Ausweis Ausserbilanzgeschäfte (Commitment-Ansatz I)

Bei einem Währungsderivat muss jeweils nur der Netto-Verkauf gedeckt sein, deshalb wird im Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte auch nur die Verkaufsseite (netto) als engagementreduzierende Derivate gezeigt.

Erläuterung 10: Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte für Brutto/Netto Darstellung (Commitment-Ansatz II)

Es wird auf eine Verrechnung gegenläufiger Derivat-Positionen verzichtet. Somit entspricht das Netto-Gesamtengagement aus Derivaten dem Wert des Brutto-Gesamtengagements.

Erläuterung 11: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden 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 Verkehrswerts 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 offenstehenden 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 offenstehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite sukzessive 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die jeweils kleinste gängige Einheit der Rechnungseinheit gerundet.
7. Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des jeweiligen Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben) sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen durchschnittlich erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Teilvermögens bewirkt. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.
Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Nettoinventarwert erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einen Durchschnittswert aus einer im Prospekt definierten Periode.
8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;

- b) auf den Stichtag von Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen, sofern (i) solche Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen nur auf einzelnen Anteilklassen (Ausschüttungsklassen beziehungsweise Thesaurierungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten der Ausschüttung beziehungsweise der Thesaurierung 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 Anteilklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedliche Kommissionsätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilklasse oder im Interesse mehrerer Anteilklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens getätigt wurden.

Erläuterung 12: Änderungen des Fondsvertrags per 4. Oktober 2023

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat die von der Fondsleitung und der Depotbank beantragten Änderungen des Fondsvertrags mit Verfügung vom 2. Oktober 2023 bewilligt. Die Änderungen sind per 4. Oktober 2023 in Kraft getreten. Die Publikationen auf der elektronischen Plattform <http://www.swissfunddata.ch> am 22. Juni 2022 und 29. September 2023 lauten wie folgt:

Die Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigt, vorbehaltlich der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA den Fondsvertrag des Fonds wie folgt zu ändern:

1. § 6 Anteile und Anteilklassen

In Bezug auf die Anteile der Klassen «DA», «DA CHF», «DA EUR», «DA USD», «DAH CHF», «DAH EUR», «DAH USD», «DA DUR CHF» und «DAH DUR CHF» und die Anteile der Klassen «DB», «DB CHF», «DB EUR», «DB USD», «DBH CHF», «DBH EUR», «DBH USD», «DB DUR CHF» und «DBH DUR CHF» wird in Ziff. 4 präzisiert, dass Anlageberatungsmandate (inkl. Credit Suisse Invest Anlagelösungen) sowie folgende Vermögensverwaltungsverträge: Private Mandates, Premium Mandates und MyChoice, nicht für diese Klassen qualifizieren (bisher: «Nicht für diese Klasse qualifizieren folgende Vermögensverwaltungsverträge: Private Mandates, Premium Mandates, MyChoice, und die Credit Suisse Invest Anlagelösungen»).

In Bezug auf die Anteile der Klassen «EA», «EA CHF», «EA EUR», «EA USD», «EAH CHF», «EAH EUR», «EAH USD», «EA DUR CHF» und «EAH DUR CHF» wird die Definition der qualifizierten Anleger in Ziff. 4, für welche diese Anteilklassen nur zugänglich sind, wie folgt angepasst:

«Anteile der Klassen «EA», «EA CHF», «EA EUR», «EA USD», «EAH CHF», «EAH EUR», «EAH USD», «EA DUR CHF» und «EAH DUR CHF» sind ausschüttende Anteile und nur zugänglich für folgende Arten von qualifizierten Anlegern:

- Professionelle Kunden gemäss Art. 4 Abs. 3-5 FIDLEG
- Qualifizierte Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die einen Vermögensverwaltungsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 Bst. a FIDLEG oder einem ausländischen Finanzintermediär, der einer gleichwertigen prudenziellen Aufsicht untersteht, abgeschlossen haben, sofern sie nicht erklärt haben, nicht als qualifizierte Anleger gelten zu wollen.

Nicht für diese Klasse qualifizieren:

- Vermögende Privatkundinnen und –kunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG, die erklärt haben, dass sie als professionelle Kunden gelten wollen
- Anlageberatungsmandate (inkl. Credit Suisse Invest Anlagelösungen).»

In Bezug auf die Anteile der Klassen «EB», «EB CHF», «EB EUR», «EB USD», «EBH CHF», «EBH EUR», «EBH USD», «EB DUR CHF» und «EBH DUR CHF» wird die Definition der qualifizierten Anleger in Ziff. 4, für welche diese Anteilklassen nur zugänglich sind, ebenfalls wie folgt angepasst:

«Anteile der Klassen «EB», «EB CHF», «EB EUR», «EB USD», «EBH CHF», «EBH EUR», «EBH USD», «EB DUR CHF» und «EBH DUR CHF» sind thesaurierende Anteile und nur zugänglich für folgende Arten qualifizierten Anlegern:

- Professionelle Kunden gemäss Art. 4 Abs. 3-5 FIDLEG
- Qualifizierte Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG, die einen Vermögensverwaltungsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 Bst. a FIDLEG oder einem ausländischen Finanzintermediär, der einer gleichwertigen prudenziellen Aufsicht untersteht, abgeschlossen haben, sofern sie nicht erklärt haben, nicht als qualifizierte Anleger gelten zu wollen.

Nicht für diese Klasse qualifizieren:

- Vermögende Privatkundinnen und –kunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG, die erklärt haben, dass sie als professionelle Kunden gelten wollen
- Anlageberatungsmandate (inkl. Credit Suisse Invest Anlagelösungen).

In Bezug auf die Anteile der Klassen «ZA CHF», «ZAH CHF», «ZA DUR CHF» und «ZAH DUR CHF» und die Anteile der Klassen «ZB CHF», «ZBH CHF», «ZB DUR CHF» und «ZBH DUR CHF» wird in Ziff. 4 ergänzt, dass Anlageberatungsmandate (inkl. Credit Suisse Invest Anlagelösungen) nicht für diese Klassen qualifizieren.

2. § 8 Anlageziel und Anlagepolitik

Ziff. 1 wird angepasst und lautet neu wie folgt:

«Das Anlageziel der Teilvermögen des Umbrella-Fonds besteht hauptsächlich darin, einen angemessenen Anlageertrag in der Rechnungs-einheit mittels Investitionen in die nachstehend je Teilvermögen aufgeführten Anlagen zu erreichen. Dabei sind die Grundsätze der Risikoverteilung, der Sicherheit des Kapitals und der Liquidität der Vermögen der Teilvermögen zu berücksichtigen.

Das spezifische Anlageziel der Teilvermögen wird unter Ziff. 3 beschrieben. Die Fondsleitung bietet nicht Gewähr dafür, dass dieses Anlageziel erreicht wird.»

Ziff. 3 wird dahingehend ergänzt, dass unter dieser Ziffer das Anlageziel und die Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen aufgeführt werden.

Es wird neu das Anlageziel des Teilvermögens **Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund** in Ziff. 3 A aufgeführt, welches wie folgt lautet:

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich in der realen Kapitalerhaltung und in der Erzielung eines Einkommens im Rahmen des Risikoprofils. Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Abschnitt 6.2 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze **«Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse und verhaltensbasierte Ausschlüsse)**, **«ESG-Integration»** für Fixed-Income-Portfolios (**integriertes ESG-Research** und **Positive Screening**) und **«Stewardship» (Engagement)** setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 20% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating und/oder keine Angaben zum Umsatz aus kontroverser Geschäftstätigkeit) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss den vorgenannten Nachhaltigkeitsansätzen nicht entsprechen. Bei Direktanlagen werden zur «ESG-Integration» einzelne Emittenten unter Verwendung von integriertem Research hinsichtlich der anhand von *Materiality Frameworks* externer Anbieter (z.B. MSCI ESG Research LLC) identifizierten ESG-Faktoren evaluiert. Die Ergebnisse dieser Analyse werden durch den Vermögensverwalter in die Erstellung eines eigenen Kreditratings mit integrierten ESG-Faktoren einbezogen, welches sich zusätzlich auf ESG-Ratings spezialisierter externer Anbieter stützt. Dieses Kreditrating mit integrierten ESG-Faktoren wird zur Auswahl von Forderungswertpapieren und -wertrechten und der Portfoliokonstruktion herangezogen. Die Gewichtung aller Titel im Fondsvermögen mit negativem ESG-Rating darf gesamthaft maximal 20% betragen. Bei Anlagen in Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) wird durch den Vermögensverwalter in der Regel einzig ein proprietäres Klassifikationsmodell angewendet, welches Zielfonds als solche (1) ohne Berücksichtigung von ESG-Faktoren, (2) nur mit Ausschlusskriterien, (3) mit einer Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess, (4) mit einem nachhaltigen Thema, oder als (5) Impact Investment einstuft. Zielfonds mit den vorstehenden Klassifikationen (1) und (2) entsprechen den für das Teilvermögen geltenden Nachhaltigkeitsvorgaben nicht und werden nicht investiert. Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

Es wird neu das Anlageziel des Teilvermögens **Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund** in Ziff. 3 B aufgeführt, welches wie folgt lautet:

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich in der realen Kapitalerhaltung und in der Erzielung eines Einkommens im Rahmen des Risikoprofils. Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Abschnitt 6.2 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze **«Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse und verhaltensbasierte Ausschlüsse)**, **«ESG-Integration»** für Fixed-Income-Portfolios (**integriertes ESG-Research** und **Positive Screening**) und **«Stewardship» (Engagement)** setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 20% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating und/oder keine Angaben zum Umsatz aus kontroverser Geschäftstätigkeit) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss den vorgenannten Nachhaltigkeitsansätzen nicht entsprechen. Bei Direktanlagen werden zur «ESG-Integration» einzelne Emittenten unter Verwendung von integriertem Research hinsichtlich der anhand von *Materiality Frameworks* externer Anbieter (z.B. MSCI ESG Research LLC) identifizierten ESG-Faktoren evaluiert. Die Ergebnisse dieser Analyse werden durch den Vermögensverwalter in die Erstellung eines eigenen Kreditratings mit integrierten ESG-Faktoren einbezogen, welches sich zusätzlich auf ESG-Ratings spezialisierter externer Anbieter stützt. Dieses Kreditrating mit integrierten ESG-Faktoren wird zur Auswahl von Forderungswertpapieren und -wertrechten und der Portfoliokonstruktion herangezogen. Die Gewichtung aller Titel im Fondsvermögen mit negativem ESG-Rating darf gesamthaft maximal 20% betragen. Bei Anlagen in Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) wird durch den Vermögensverwalter in der Regel einzig ein proprietäres Klassifikationsmodell angewendet, welches Zielfonds als solche (1) ohne Berücksichtigung von ESG-Faktoren, (2) nur mit Ausschlusskriterien, (3) mit einer Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess, (4) mit einem nachhaltigen Thema, oder als (5) Impact Investment einstuft. Zielfonds mit den vorstehenden Klassifikationen (1) und (2) entsprechen den für das Teilvermögen geltenden Nachhaltigkeitsvorgaben nicht und werden nicht investiert.

Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

3. § 20 Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen

In Ziff. 1 wird der Absatz betreffend die **«DA-, DAH-, DB- und DBH-Klassen (alle Währungen)»** angepasst, welcher neu wie folgt lautet:

«DA-, DAH-, DB- und DBH-Klassen (alle Währungen)»

Für die «DA», «DA DUR», «DAH», «DAH DUR», «DB», «DB DUR», «DBH» und «DBH DUR»-Klassen (alle Währungen) stellt die Fondsleitung zulasten der jeweiligen Teilvermögen (jeweils lediglich anteilmässig und für alle Währungen) eine pauschale Verwaltungskommission von jährlich maximal 0.20% des Nettofondsvermögens des Teilvermögens in Rechnung, die pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettoinventarwertes dem Fondsvermögen belastet und jeweils am Anfang jeden Monats auf der Basis des anteilmässigen durchschnittlichen Nettovermögens der Teilvermögen des Vormonats ausbezahlt wird (pauschale Verwaltungskommission). Diese pauschale Verwaltungskommission enthält die Entschädigung für die Leitung, die Vertriebstätigkeit, Dienstleistungen im Bereich der Währungsabsicherung bei währungsbesicherten Anteilklassen (FX Hedging) sowie für die Aufbewahrung des Fondsvermögens, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen in § 4 aufgeführten Aufgaben der Depotbank. Die Entschädigung für die Vermögensverwaltung wird nicht dem Vermögen des Teilvermögens belastet, sondern gemäss § 6 Ziff. 4 direkt bei den Anlegern erhoben und dem Vermögensverwalter aufgrund einer separaten vertraglichen Vereinbarung zwischen Rechtseinheiten der Credit Suisse Gruppe vergütet. Nicht zwingend in der pauschalen Verwaltungskommission enthalten sind Vergütungen und Nebenkosten gemäss nachfolgender Ziff. 3 lit. a. bis e. und i. bis k., welche direkt dem Vermögen des Teilvermögens belastet werden können. Für die «DA», «DA DUR», «DAH», «DAH DUR», «DB», «DB DUR», «DBH» und «DBH DUR»-Klassen (alle Währungen) kommt die folgende Ziff. 2 nicht zur Anwendung. Der effektiv angewandte Satz der Verwaltungskommission bzw. der pauschalen Verwaltungskommission je Teilvermögen ist jeweils aus dem Jahres- und Halbjahresbericht ersichtlich.»

In Ziff. 1 wird weiter der Absatz betreffend die **«ZA CHF-, ZAH CHF-, ZA DUR CHF-, ZAH DUR CHF-, ZB CHF-, ZBH CHF-, ZB DUR CHF- und ZBH DUR CHF-Klassen»** angepasst, welcher neu wie folgt lautet:

«ZA CHF-, ZAH CHF-, ZA DUR CHF-, ZAH DUR CHF-, ZB CHF-, ZBH CHF-, ZB DUR CHF- und ZBH DUR CHF-Klassen»

Dem Vermögen der einzelnen Teilvermögen wird keine pauschale Verwaltungskommission belastet. Die Entschädigung für die Leitung, die Vermögensverwaltung und für die Aufbewahrung des Vermögens der einzelnen Teilvermögen, die Besorgung des Zahlungsverkehrs der Teilvermögen und die sonstigen in § 4 aufgeführten Aufgaben der Depotbank wird gemäss § 6 Ziff. 4 im Rahmen der genannten Verträge direkt bei den Anlegern erhoben und der Fondsleitung, dem Vermögensverwalter sowie der Depotbank aufgrund einer separaten vertraglichen Vereinbarung zwischen Rechtseinheiten der Credit Suisse Gruppe vergütet.»

In Ziff. 2 wird die Formulierung, wonach für die DA-, DAH-, DB- und DBH-Klassen (alle Währungen) eine pauschale Verwaltungskommission zur Anwendung kommt und keine separate Depotbankkommission erhoben wird, gestrichen.

Ziff. 3 wird um eine neue Bst. a ergänzt, welche wie folgt lautet:

«Kosten für den An- und Verkauf von Anlagen, namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben, sowie Kosten für Continuous Linked Settlement (CLS), sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen»

In diesem Zusammenhang wird auch Ziff. 4 angepasst, welche neu wie folgt lautet:

«Die Kosten nach Ziff. 3 Bst. a werden, soweit möglich, direkt dem Einstandswert zugeschlagen bzw. dem Verkaufswert der betreffenden Anlagen abgezogen, ansonsten unter den Aufwendungen.»

4. FIDLEG/AMAS-Änderungen

Im Weiteren wurden im Fondsvertrag und im Prospekt Anpassungen an die neuen rechtlichen und regulatorischen Vorgaben vorgenommen gemäss: (i) dem Bundesgesetz über die Finanzdienstleistungen (FIDLEG) vom 15. Juni 2018, dem Bundesgesetz über die Finanzinstitute (FINIG) vom 15. Juni 2018 sowie deren ausführenden Verordnungen, (ii) dem Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) vom 23. Juni 2006 (Stand am 1. Januar 2020 und dessen ausführende Verordnungen, sowie (iii) dem Musterprospekt mit integriertem Musterfondsvertrag eines schweizerischen Effektenfonds (für Einzelfonds) der Asset Management Association Switzerland (AMAS) vom 20. Mai 2015 (Stand am 27. August 2021).

5. Formelle bzw. redaktionelle Änderungen

Zusätzlich wurden weitere formelle Änderungen vorgenommen, welche die Interessen der Anleger nicht tangieren und daher nicht veröffentlicht werden.

6. Änderungen des Prospekts

Der Prospekt des Fonds wird entsprechend angepasst.

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

Ergänzung zur Publikation vom 22. Juni 2022

In Bezug auf die Publikation vom 22. Juni 2022 auf der elektronischen Plattform www.swissfunddata.ch, mit welcher die Anlegerinnen und Anleger über eine von der Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich, als Depotbank, vorbehaltlich der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA («FINMA») beabsichtigte Änderung des Fondsvertrages informiert wurden, erfolgt hiermit eine Nachpublikation.

1. § 8 Anlageziel und Anlagepolitik

Das Anlageziel des Teilvermögens Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund in Ziff. 3 A wird ergänzt und lautet neu wie folgt (Ergänzungen gegenüber der in der Mitteilung vom 22. Juni 2022 publizierten Fassung sind unterstrichen):

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich in der realen Kapitalerhaltung und in der Erzielung eines Einkommens im Rahmen des Risikoprofils. Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Abschnitt 6.2 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze «Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse und verhaltensbasierte Ausschlüsse), «ESG-Integration» für Fixed-Income-Portfolios (integriertes ESG-Research und Positive Screening) und «Stewardship» (Engagement) setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 20% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating und/oder keine Angaben zum Umsatz aus kontroverser Geschäftstätigkeit) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss den vorgenannten Nachhaltigkeitsansätzen nicht entsprechen. Der Vermögensverwalter ist bestrebt, die Abdeckung des Vermögens des Teilvermögens durch ESG-Daten zu erhöhen. Bei Direktanlagen werden zur «ESG-Integration» einzelne Emittenten unter Verwendung von integriertem Research hinsichtlich der anhand von Materiality Frameworks externer Anbieter (z.B. MSCI ESG Research LLC) identifizierten ESG-Faktoren evaluiert. Die Ergebnisse dieser Analyse werden durch den Vermögensverwalter in die Erstellung eines eigenen Kreditratings mit integrierten ESG-Faktoren einbezogen, welches sich zusätzlich auf ESG-Ratings spezialisierter externer Anbieter stützt. Dieses Kreditrating mit integrierten ESG-Faktoren wird zur Auswahl von Forderungswertpapieren und -wertrechten und der Portfoliokonstruktion herangezogen. Die Gewichtung aller Titel im Fondsvermögen mit negativem ESG-Rating darf gesamthaft maximal 20% betragen. Bei Anlagen in Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) wird durch den Vermögensverwalter in der Regel einzig ein proprietäres Klassifikationsmodell angewendet, welches Zielfonds als solche (1) ohne Berücksichtigung von ESG-Faktoren, (2) nur mit Ausschlusskriterien, (3) mit einer Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess, (4) mit einem nachhaltigen Thema, oder als (5) Impact Investment einstuft. Zielfonds mit den vorstehenden Klassifikationen (1) und (2) entsprechen den für das Teilvermögen geltenden Nachhaltigkeitsvorgaben nicht und werden nicht investiert.

Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

Das Anlageziel des Teilvermögens Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund in Ziff. 3 B wird ergänzt und lautet neu wie folgt (Ergänzungen gegenüber der in der Mitteilung vom 22. Juni 2022 publizierten Fassung sind unterstrichen):

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich in der realen Kapitalerhaltung und in der Erzielung eines Einkommens im Rahmen des Risikoprofils. Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Abschnitt 6.2 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze «Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse und verhaltensbasierte Ausschlüsse), «ESG-Integration» für Fixed-Income-Portfolios (integriertes ESG-Research und Positive Screening) und «Stewardship» (Engagement) setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 20% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating und/oder keine Angaben zum Umsatz aus kontroverser Geschäftstätigkeit) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss den vorgenannten Nachhaltigkeitsansätzen nicht entsprechen. Der Vermögensverwalter ist bestrebt, die Abdeckung des Vermögens des Teilvermögens durch ESG-Daten zu erhöhen. Bei Direktanlagen werden zur «ESG-Integration» einzelne Emittenten unter Verwendung von integriertem Research hinsichtlich der anhand von Materiality Frameworks externer Anbieter (z.B. MSCI ESG Research LLC) identifizierten ESG-Faktoren evaluiert. Die Ergebnisse dieser Analyse werden durch den Vermögensverwalter in die Erstellung eines eigenen Kreditratings mit integrierten ESG-Faktoren einbezogen, welches sich zusätzlich auf ESG-Ratings spezialisierter externer Anbieter stützt. Dieses Kreditrating mit integrierten ESG-Faktoren wird zur Auswahl von Forderungswertpapieren und -wertrechten und der Portfoliokonstruktion herangezogen. Die Gewichtung aller Titel im Fondsvermögen mit negativem ESG-Rating darf gesamthaft maximal 20% betragen. Bei Anlagen in Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) wird durch den Vermögensverwalter in der Regel einzig ein proprietäres Klassifikationsmodell angewendet, welches Zielfonds als solche (1) ohne Berücksichtigung von ESG-Faktoren, (2) nur mit Ausschlusskriterien, (3) mit einer Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess, (4) mit einem nachhaltigen Thema, oder als (5) Impact Investment einstuft. Zielfonds mit den vorstehenden Klassifikationen (1) und (2) entsprechen den für das Teilvermögen geltenden Nachhaltigkeitsvorgaben nicht und werden nicht investiert.

Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

2. Formelle bzw. redaktionelle Änderungen 2

Zusätzlich wurden weitere formelle Änderungen vorgenommen, welche die Interessen der Anlegerinnen und Anleger nicht tangieren und daher nicht veröffentlicht werden.

3. Änderungen des Prospekts

Der Prospekt des Fonds wird entsprechend angepasst.

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

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfungsgesellschaft

an den Verwaltungsrat der Fondsleitung Credit Suisse Funds AG, Zürich

Kurzbericht zur Prüfung der Jahresrechnung

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Umbrella-Fonds CS Fund 2 mit den Teilvermögen

- Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund
- Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigefügte Jahresrechnung (Seiten 3 bis 44) 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 Prüfungsgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung“ 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

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Fondsleitung für die Jahresrechnung

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

Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfungsgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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

einzelnen oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung 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 Unvollständigkeiten, 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 des Anlagefonds 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 bzw. dessen zuständigem Ausschuss 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.

PricewaterhouseCoopers AG

Raffael Simone

Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Prüfer

Yael Fries

Zugelassene Revisionsexpertin

Zürich, 31. Januar 2024

CREDIT SUISSE 

Credit Suisse Funds AG

Uetlibergstrasse 231

CH-8070 Zürich

www.credit-suisse.com