

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE HEDGED CHF

Jahresbericht per 31.01.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	70090	CHF
BA CHF	20594694	CHF
CT CHF	37864032	CHF
DA CHF	2561682	CHF
DT CHF	35656961	CHF
GT CHF	19224150	CHF
MT CHF	51788926	CHF
NT CHF	19224149	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte 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 der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	21
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	21
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	22
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	22
8	Pauschale Verwaltungskommission	23
9	Benchmark	23
10	TER	23
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	24
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	24
13	Fussnoten	24
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	25
15	Pflichtpublikationen	27

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'762'211'002.13	1'753'830'780.01	1'943'684'018.26	1'691'623'929.10
Klasse AA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		198'396'067.67	231'948'271.41	304'496'219.92	376'761'290.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'381'202.042	2'745'263.380	3'120'838.572	3'611'544.274
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.3176	84.4904	97.5687	104.3200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		83.2093	84.6509	97.4224	104.5000
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.85	1.80	2.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'513'162.22	20'662'831.91	25'048'683.12	26'792'591.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		132'652.392	257'044.488	270'023.269	269'865.018
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.2535	80.3862	92.7649	99.2800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		79.1504	80.5389	92.6258	99.4500
Ausschüttung je Anteil		1.95	2.10	2.00	2.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		56'299'296.50	62'455'732.59	78'488'613.26	85'511'804.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		628'032.278	699'815.137	774'156.515	801'399.348
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.6440	89.2460	101.3860	106.7000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.5274	89.4156	101.2339	106.8800
Thesaurierung je Anteil		2.14	2.25	2.37	2.61
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		66'594'545.50	75'248'041.30	75'406'133.91	75'622'601.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		776'621.518	864'971.866	750'128.820	702'479.390
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.7490	86.9948	100.5242	107.6500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		85.6376	87.1601	100.3735	107.8300
Ausschüttung je Anteil		2.10	2.40	2.40	2.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		42'649'012.18	46'945'573.61	71'139'696.12	66'650'424.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		469'252.595	519'061.794	692'675.145	616'911.371
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.8871	90.4431	102.7028	108.0400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		90.7690	90.6150	102.5488	108.2200
Thesaurierung je Anteil		2.24	2.34	2.47	2.72
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		100'132'127.51	112'913'905.06	123'177'562.79	157'972'286.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'006'089.424	1'140'815.765	1'096'612.402	1'337'804.439
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.5261	98.9765	112.3255	118.0800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.3967	99.1645	112.1570	118.2800
Thesaurierung je Anteil		2.54	2.66	2.82	3.08
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse MT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'792'936.00	7'495'994.33	8'774'359.16	6'054'078.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		53'867.517	84'932.517	87'812.517	57'789.558
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		88.9764	88.2582	99.9215	104.7600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		88.8607	88.4259	99.7716	104.9400
Thesaurierung je Anteil		2.63	2.72	2.92	3.13
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'282'833'854.55	1'196'160'429.80	1'257'152'749.98	896'258'852.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'522'394.937	11'771'338.273	10'927'496.357	7'430'353.528
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		102.4432	101.6164	115.0449	120.6200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		102.3100	101.8094	114.8723	120.8300
Thesaurierung je Anteil		3.00	3.14	3.36	3.61
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	0.56 %	3.94 %	-16.78 %	-2.70 %
Klasse BA CHF	0.99 %	4.38 %	-16.43 %	-2.29 %
Klasse CT CHF	1.04 %	4.43 %	-16.38 %	-2.24 %
Klasse DA CHF	1.44 %	4.88 %	-16.51 %	-2.17 %
Klasse DT CHF	1.43 %	4.88 %	-16.51 %	-2.16 %
Klasse GT CHF	1.54 %	4.99 %	-16.42 %	-2.07 %
Klasse MT CHF	1.62 %	5.03 %	-15.90 %	-1.68 %
Klasse NT CHF	1.94 %	5.41 %	-16.09 %	-1.68 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	30'161'808.06	32'164'530.75
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'612'015'134.08	1'610'408'336.51
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	93'376'968.16	87'685'521.39
Derivative Finanzinstrumente	8'035'074.97	6'853'671.70
Sonstige Vermögenswerte	18'930'518.30	17'658'921.30
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'762'519'503.57	1'754'770'981.65
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-592'026.34
Andere Verbindlichkeiten	-308'501.44	-348'175.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'762'211'002.13	1'753'830'780.01

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'745'263.380	3'120'838.572
Ausgegebene Anteile		89'957.103	97'414.601
Zurückgenommene Anteile		-454'018.441	-472'989.793
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'381'202.042	2'745'263.380
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		257'044.488	270'023.269
Ausgegebene Anteile		23'775.415	18'077.933
Zurückgenommene Anteile		-148'167.511	-31'056.714
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		132'652.392	257'044.488
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		699'815.137	774'156.515
Ausgegebene Anteile		35'430.604	21'478.144
Zurückgenommene Anteile		-107'213.463	-95'819.522
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		628'032.278	699'815.137
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		864'971.866	750'128.820
Ausgegebene Anteile		51'217.383	176'212.420
Zurückgenommene Anteile		-139'567.731	-61'369.374
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		776'621.518	864'971.866
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		519'061.794	692'675.145
Ausgegebene Anteile		22'407.120	67'709.455
Zurückgenommene Anteile		-72'216.319	-241'322.806
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		469'252.595	519'061.794
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'140'815.765	1'096'612.402
Ausgegebene Anteile		194'490.350	165'952.123
Zurückgenommene Anteile		-329'216.691	-121'748.760
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'006'089.424	1'140'815.765
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		84'932.517	87'812.517
Zurückgenommene Anteile		-31'065.000	-2'880.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		53'867.517	84'932.517
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'771'338.273	10'927'496.357
Ausgegebene Anteile		1'351'307.753	1'377'180.102
Zurückgenommene Anteile		-600'251.089	-533'338.186
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'522'394.937	11'771'338.273

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'753'830'780.01	1'943'684'018.26
Ausbezahlte Ausschüttung		-7'416'429.81	-7'649'436.98
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-15'404'195.70	-15'577'774.84
Saldo aus dem Anteilverkehr		878'425.33	46'487'685.97
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		30'322'422.30	-213'113'712.40
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'762'211'002.13	1'753'830'780.01

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		612'921.61	6'223.50
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'743.64	-78'404.82
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		48'254'471.30	52'246'412.95
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		2'759'557.07	1'214'908.80
Erträge aus Wertpapierleihe		368'868.75	365'909.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'448'339.98	2'499'209.81
Total Ertrag		54'442'415.07	56'254'259.59
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-430.97
Reglementarische Vergütungen		-3'590'477.51	-4'168'395.93
Sonstige Aufwendungen		-504.00	-414.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'401'663.16	-1'849'287.52
Total Aufwand		-5'992'644.67	-6'018'528.43
Nettoertrag / Verlust			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-380'924.25	-58'416'538.72
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		426'081.76	527'143.04
Realisierter Erfolg		48'494'927.91	-7'653'664.52
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-18'172'505.61	-205'460'047.88
Gesamterfolg		30'322'422.30	-213'113'712.40

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	3'853'174.58	4'699'147.97
Vortrag des Vorjahres	53'610.13	433'199.41
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'906'784.71	5'132'347.38
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	3'809'923.27	5'078'737.25
Vortrag auf neue Rechnung	96'861.44	53'610.13
Total	3'906'784.71	5'132'347.38
Klasse BA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	250'560.97	508'874.33
Vortrag des Vorjahres	12'136.94	43'056.04
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	262'697.91	551'930.37
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	258'672.16	539'793.43
Vortrag auf neue Rechnung	4'025.75	12'136.94
Total	262'697.91	551'930.37
Klasse CT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'347'318.28	1'575'502.95
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'347'318.28	1'575'502.95
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	471'561.40	551'426.03
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	875'756.88	1'024'076.92
Total	1'347'318.28	1'575'502.95
Klasse DA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'645'462.92	1'977'094.82
Vortrag des Vorjahres	11'378.80	110'216.46
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'656'841.72	2'087'311.28
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'630'905.19	2'075'932.48
Vortrag auf neue Rechnung	25'936.53	11'378.80
Total	1'656'841.72	2'087'311.28
Klasse DT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'051'437.52	1'217'141.31
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'051'437.52	1'217'141.31
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	368'003.13	425'999.46
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	683'434.39	791'141.85
Total	1'051'437.52	1'217'141.31
Klasse GT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	2'564'961.80	3'040'433.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'564'961.80	3'040'433.86
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	897'736.63	1'064'151.85
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'667'225.17	1'976'282.01
Total	2'564'961.80	3'040'433.86
Klasse MT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	141'965.15	231'778.99
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	141'965.15	231'778.99
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	49'687.80	81'122.65
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	92'277.35	150'656.34
Total	141'965.15	231'778.99
Klasse NT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	37'594'889.18	36'985'756.93
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	37'594'889.18	36'985'756.93
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	13'158'211.21	12'945'014.93
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	24'436'677.97	24'040'742.00
Total	37'594'889.18	36'985'756.93

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'612'015'134.08	91.46		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'612'015'134.08	91.46		
AU3CB0243764	4.0000 % TLSAU 4 04/19/27 MTN	11'000	0	0	11'000 AUD	98.75%	6'160'174.92	0.35	a)	
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	5'550	0	0	5'550 AUD	99.18%	3'121'464.29	0.18	a)	
AUD							9'281'639.21	0.53		
CA00206RDY59	4.8500 % T 4.85 05/25/47 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	90.48%	1'161'942.79	0.07	a)	
CA06368LB887	4.5370 % BMO 4.537 12/18/28	0	2'000	0	2'000 CAD	99.79%	1'281'444.98	0.07	a)	
CA0641515959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	10'000	0	0	10'000 CAD	95.69%	6'144'203.41	0.35	a)	
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	3'000	0	0	3'000 CAD	75.54%	1'455'091.85	0.08	a)	
CA07813ZCE21	2.5000 % BCECN 2 1/2 05/14/30 MTN	4'000	0	0	4'000 CAD	88.69%	2'277'738.39	0.13	a)	
CA29251ZBU09	3.1000 % ENBCN 3.1 09/21/33 MTN	10'000	0	0	10'000 CAD	85.43%	5'485'352.01	0.31	a)	
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	3'000	2'000	0	5'000 CAD	90.99%	2'921'188.39	0.17	a)	
CA775109BJ98	3.2500 % RCICN 3 1/4 05/01/29	0	5'000	0	5'000 CAD	93.32%	2'995'913.58	0.17	a)	
CA780086RA47	2.7400 % RY 2.74 07/25/29	11'000	0	11'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00		
CA780086WK63	5.0100 % RY 5.01 02/01/33	0	11'000	0	11'000 CAD	100.24%	7'080'037.04	0.40	a)	
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	8'000	1'000	0	9'000 CAD	92.78%	5'361'326.53	0.30	a)	
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	13'000	0	0	13'000 CAD	94.69%	7'903'789.71	0.45	a)	
CAD							44'068'028.68	2.50		
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	5'000	1'500	0	6'500 CHF	99.50%	6'467'500.00	0.37	a)	
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	0	4'000	0	4'000 CHF	90.31%	3'612'240.00	0.20	a)	
CHF							10'079'740.00	0.57		
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	1'900	2'100	0	4'000 EUR	93.64%	3'490'366.70	0.20	a)	
AT0000A2L583	4.2500 % ERSTBK 4 1/4 PERP PERP	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	100.95%	4'703'451.95	0.27	a)	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	0	5'000	0	5'000 EUR	106.46%	4'960'219.89	0.28	a)	
BE6317598850	3.8750 % AGSBB 3 7/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	81.41%	1'668'837.87	0.09	a)	
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	4'100	0	1'100	3'000 EUR	80.71%	2'256'287.14	0.13	a)	
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	88.27%	4'935'200.04	0.28	a)	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	6'000	0	0	6'000 EUR	99.56%	5'566'594.79	0.32	a)	
CH1214797172	7.7500 % UBS 7 3/4 03/01/29	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	88.43%	4'120'307.78	0.23	a)	
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	8'000	0	0	8'000 EUR	79.08%	5'895'104.93	0.33	a)	
DE000A25BDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	107.84%	2'009'862.59	0.11	a)	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	4'900	0	0	4'900 EUR	102.26%	4'669'380.23	0.26	a)	
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3.7 05/30/31 EMTN	0	4'800	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
DE000C245W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	6'300	0	2'300	4'000 EUR	97.92%	3'649'860.08	0.21	a)	
DE000C245W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	105.35%	2'454'321.33	0.14	a)	
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	84.38%	3'145'176.65	0.18	a)	
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'400	0	0	1'400 EUR	94.57%	1'233'708.69	0.07	a)	
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	4'000	3'000	0	7'000 EUR	96.40%	6'288'238.04	0.36	a)	
DE000LB2CPE5	4.0000 % LBBW 4 PERP EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	8'000	0	0	8'000 EUR	103.02%	7'680'059.12	0.44	a)	
FR0013331949	3.1250 % FRPTT 3 1/8 PERP	2'500	0	0	2'500 EUR	96.62%	2'250'831.22	0.13	a)	
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	6'100	0	1'000	5'100 EUR	85.13%	4'045'743.04	0.23	a)	
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	93.77%	1'747'512.94	0.10	a)	
FR00140046Y4	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 PERP	3'100	1'400	0	4'500 EUR	83.18%	3'487'920.62	0.20	a)	
FR0014006KD4	1.1250 % BFCM 1 1/8 11/19/31 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	80.24%	3'738'626.96	0.21	a)	
FR0014006NI7	0.5000 % BNP 0 1/2 05/30/28 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	4'600	0	0	4'600 EUR	88.60%	3'797'970.13	0.22	a)	
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	4'400	0	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	6'800	0	3'800	3'000 EUR	105.31%	2'943'899.66	0.17	a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR001400F1G3	3.6250 % ENGIFP 3 5/8 01/11/30 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	102.40%	4'198'529.98	0.24	a)
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	102.23%	2'381'544.79	0.14	a)
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	104.89%	2'052'530.52	0.12	a)
FR001400KCC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	0	2'200	0	2'200 EUR	105.29%	2'158'429.24	0.12	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	105.92%	5'921'736.86	0.34	a)
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	104.10%	2'424'991.73	0.14	a)
XS1048529041	2.5000 % RDSALN 2 1/2 03/24/26 EMTN	3'115	0	3'115	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	99.38%	5'556'530.94	0.32	a)
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	7'000	0	5'000	2'000 EUR	97.85%	1'823'644.10	0.10	a)
XS1548475968	7.7500 % ISPIM 7 3/4 PERP	0	3'000	0	3'000 EUR	103.22%	2'885'389.56	0.16	a)
XS1640667116	8.6590 % RBAIV 8.659 PERP	2'600	0	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1640903701	4.7500 % HSBC 4 3/4 PERP EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1693822634	4.7500 % ABNAV 4 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	92.13%	3'433'822.77	0.19	a)
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	90.49%	3'373'029.67	0.19	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	5'000	0	0	5'000 EUR	93.36%	4'349'726.27	0.25	a)
XS1785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1793250041	4.7500 % SANTAN 4 3/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	93.55%	4'358'858.29	0.25	a)
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877860533	4.6250 % RABOBK 4 5/8 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	96.84%	5'414'295.20	0.31	a)
XS2010028343	2.8750 % SESGFP 2 7/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	93.29%	3'477'395.51	0.20	a)
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	4'000	0	2'000	2'000 EUR	85.46%	1'592'697.39	0.09	a)
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	2'000	0	0	2'000 EUR	92.55%	1'724'738.82	0.10	a)
XS2022424993	1.7500 % ISPIM 1 3/4 07/04/29 EMTN	0	4'000	2'000	2'000 EUR	92.23%	1'718'905.52	0.10	a)
XS2050933972	3.2500 % RABOBK 3 1/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	90.90%	4'235'249.98	0.24	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	8'000	0	0	8'000 EUR	85.16%	6'348'052.71	0.36	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	85.44%	3'980'765.05	0.23	a)
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	3'800	0	0	3'800 EUR	86.90%	3'076'938.16	0.17	a)
XS2102912966	4.3750 % SANTAN 4 3/8 PERP	1'000	0	0	1'000 EUR	92.07%	857'943.18	0.05	a)
XS2109819859	2.5020 % TELEFO 2.502 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	93.25%	2'606'788.65	0.15	a)
XS2131567138	4.3750 % ABNAV 4 3/8 PERP	0	1'000	0	1'000 EUR	96.22%	896'623.77	0.05	a)
XS2182055009	3.7500 % FIRMEN 3 3/4 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	98.03%	2'009'678.09	0.11	a)
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	97.06%	3'617'581.21	0.21	a)
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	0	3'000	0	3'000 EUR	91.60%	2'560'606.77	0.15	a)
XS2189784288	6.1250 % CMZB 6 1/8 PERP	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	0	6'150	0	6'150 EUR	94.07%	5'390'966.64	0.31	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	6'000	0	0	6'000 EUR	86.97%	4'862'516.69	0.28	a)
XS2201857534	2.4290 % ASSGEN 2.429 07/14/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	86.97%	3'241'677.79	0.18	a)
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	93.92%	4'375'957.51	0.25	a)
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	96.72%	1'802'472.74	0.10	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	4'000	0	0	4'000 EUR	93.41%	3'481'756.52	0.20	a)
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	4'800	0	0	4'800 EUR	82.79%	3'703'138.84	0.21	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	94.75%	2'648'749.32	0.15	a)
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	4'300	1'700	0	6'000 EUR	85.95%	4'805'655.94	0.27	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	84.40%	3'932'216.29	0.22	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	2'800	0	0	2'800 EUR	79.27%	2'068'270.20	0.12	a)
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	7'600	0	2'600	5'000 EUR	88.58%	4'127'296.56	0.23	a)
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	4'300	0	0	4'300 EUR	53.39%	2'139'285.56	0.12	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	78.02%	2'035'525.41	0.12	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	6'000	0	0	6'000 EUR	90.21%	5'043'665.98	0.29	a)
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	82.45%	3'841'268.91	0.22	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	3'900	600	0	4'500 EUR	91.92%	3'854'454.41	0.22	a)
XS2342732562	3.7480 % VW 3.748 PERP	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	1'700	3'300	0	5'000 EUR	89.56%	4'172'863.43	0.24	a)
XS2353073161	2.6250 % POSIM 2 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	84.37%	1'572'346.05	0.09	a)
XS2353473692	1.3750 % RBAIV 1 3/8 06/17/33	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	5'000	2'000	0	7'000 EUR	85.15%	5'554'089.52	0.32	a)
X52357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52360310044	0.8000 % UC GIM 0.8 07/05/29 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	89.15%	3'655'063.46	0.21	a)
X52362994068	2.2500 % TNE MAK 2 1/4 07/20/28 REGS	7'000	0	0	7'000 EUR	87.23%	5'689'569.44	0.32	a)
X52381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	8'000	0	0	8'000 EUR	78.87%	5'879'300.96	0.33	a)
X52386220698	1.3750 % LLY 1 3/8 09/14/61	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	4'400	0	1'000	3'400 EUR	86.35%	2'735'782.98	0.16	a)
X52388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	76.52%	1'426'103.40	0.08	a)
X52388876232	0.9660 % MBKPW 0.966 09/21/27 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	1'300	0	0	1'300 EUR	89.90%	1'089'038.99	0.06	a)
X52410367747	2.8800 % TELEFO 2.88 PERP	3'100	0	0	3'100 EUR	92.63%	2'675'656.14	0.15	a)
X52412267358	1.0000 % ATIM 1 11/25/26 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	7'500	0	0	7'500 EUR	77.76%	5'434'339.03	0.31	a)
X52434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	7'300	0	2'500	4'800 EUR	93.83%	4'196'983.13	0.24	a)
X52436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	87.44%	2'444'509.08	0.14	a)
X52437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	91.57%	1'877'204.28	0.11	a)
X52439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	5'400	0	1'900	3'500 EUR	81.19%	2'647'924.64	0.15	a)
X52451803063	5.3750 % BAYNGR 5 3/8 03/25/2082	5'600	0	5'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52455392584	2.6250 % SABS M 2 5/8 03/24/26 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	600	0	0	600 EUR	108.58%	607'084.96	0.03	a)
X52464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	4'800	0	1'500	3'300 EUR	96.06%	2'953'876.85	0.17	a)
X52466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	6'800	0	0	6'800 EUR	91.63%	5'806'259.78	0.33	a)
X52486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52526486159	5.2500 % NN GRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	102.22%	6'667'346.98	0.38	a)
X52528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	5'600	0	0	5'600 EUR	101.67%	5'305'176.98	0.30	a)
X52536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	105.49%	2'752'414.42	0.16	a)
X52549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	3'700	0	0	3'700 EUR	111.51%	3'844'538.73	0.22	a)
X52554581830	7.0000 % ASRNED 7 12/07/43	2'000	0	0	2'000 EUR	113.17%	2'109'159.24	0.12	a)
X52560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	6'600	0	1'600	5'000 EUR	101.85%	4'745'477.84	0.27	a)
X52560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	3'900	0	0	3'900 EUR	102.24%	3'715'682.31	0.21	a)
X52575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	10'000	0	2'000	8'000 EUR	101.77%	7'586'949.88	0.43	a)
X52576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	106.11%	1'483'145.86	0.08	a)
X52591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	3'250	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	0	4'800	0	4'800 EUR	104.69%	4'682'463.23	0.27	a)
X52592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	5'350	0	5'350 EUR	103.77%	5'173'080.56	0.29	a)
X52595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	0	2'500	0	2'500 EUR	105.35%	2'454'228.15	0.14	a)
X52598649254	3.8750 % NESV FH 3 7/8 03/16/29 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	102.53%	3'630'606.44	0.21	a)
X52609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	6'800	0	6'800 EUR	105.60%	6'691'595.27	0.38	a)
X52626022573	4.1250 % WPPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	106.22%	3'959'230.27	0.22	a)
X52636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	104.70%	3'902'425.43	0.22	a)
X52644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	3'000	0	3'000 EUR	105.66%	2'953'767.83	0.17	a)
X52646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	0	4'300	0	4'300 EUR	107.96%	4'325'972.79	0.25	a)
X52671621402	3.8750 % VL VY 3 7/8 08/29/26 EMTN	0	3'800	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	3'600	0	3'600 EUR	107.86%	3'618'356.50	0.21	a)
X52678939427	9.1250 % ISPIM 9 1/8 PERP	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	0	2'900	0	2'900 EUR	105.27%	2'844'661.72	0.16	a)
X52684826014	6.6250 % BAYNGR 6 5/8 09/25/2083 NC5	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	104.97%	3'717'006.46	0.21	a)
X52694995163	3.6250 % ASRNED 3 5/8 12/12/28	0	2'000	0	2'000 EUR	100.79%	1'878'417.54	0.11	a)
X52708134023	7.8620 % VARNO 7.862 11/15/2083	0	5'000	0	5'000 EUR	106.83%	4'977'552.08	0.28	a)
X52711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	106.91%	1'494'369.85	0.08	a)
X52715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	8'300	0	8'300 EUR	107.00%	8'275'343.29	0.47	a)
X52726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	0	4'300	0	4'300 EUR	105.45%	4'225'199.18	0.24	a)
X52728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	0	5'450	0	5'450 EUR	102.66%	5'213'706.83	0.30	a)
X52737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	0	4'100	0	4'100 EUR	101.99%	3'896'716.99	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2747610751	3.8750 % ABNANV 3 7/8 01/15/32 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	100.49%	2'809'183.85	0.16	a)
XS2750308483	4.7500 % ATLM 4 3/4 01/24/29 EMTN	0	3'900	0	3'900 EUR	100.82%	3'663'968.47	0.21	a)
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	0	5'300	0	5'300 EUR	101.06%	4'990'992.91	0.28	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	2'000	0	2'000 EUR	101.94%	1'899'831.17	0.11	a)
EUR							431'037'947.60	24.46	
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	90.82%	2'976'432.27	0.17	a)
XS0498768315	6.0000 % HSBC 6 03/29/40 EMTN	3'500	0	3'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	4'000	0	2'000	2'000 GBP	98.00%	2'141'161.00	0.12	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	2'000	0	0	2'000 GBP	98.72%	2'156'957.52	0.12	a)
XS0932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	3'000	2'000	0	5'000 GBP	83.60%	4'566'080.45	0.26	a)
XS1242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	95.15%	2'078'848.84	0.12	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 GBP	94.74%	8'279'563.69	0.47	a)
XS1492680902	2.1250 % CDTFIN 2 1/8 09/22/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	88.77%	1'939'476.74	0.11	a)
XS1492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	2'000	1'500	0	3'500 GBP	70.22%	2'684'824.71	0.15	a)
XS1891174424	3.7500 % DLR 3 3/4 10/17/30	2'500	0	0	2'500 GBP	91.88%	2'509'418.84	0.14	a)
XS2035363485	1.3750 % SANTAN 1 3/8 07/31/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	5'000	0	0	5'000 GBP	73.79%	4'030'680.96	0.23	a)
XS2195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	2'000	0	0	2'000 GBP	94.98%	2'075'243.83	0.12	a)
XS2244418609	1.0000 % ENELIM 1 10/20/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	5'600	0	0	5'600 GBP	103.62%	6'338'815.37	0.36	a)
XS2575900977	8.5000 % LLOYDS 8 1/2 PERP	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2636324274	8.3750 % BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN	0	3'000	0	3'000 GBP	107.06%	3'508'663.72	0.20	a)
XS2685873908	6.8000 % HSBC 6.8 09/14/31	0	3'500	0	3'500 GBP	107.88%	4'124'831.96	0.23	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	4'900	900	4'000 GBP	103.83%	4'536'945.36	0.26	a)
GBP							53'947'945.26	3.06	
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	360'000	0	0	360'000 JPY	100.06%	2'113'986.68	0.12	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.99%	5'868'297.88	0.33	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	360'000	0	0	360'000 JPY	99.07%	2'093'023.51	0.12	a)
XS1702964351	2.1080 % AFL 2.108 10/23/47	200'000	0	0	200'000 JPY	100.47%	1'179'223.06	0.07	a)
JPY							11'254'531.13	0.64	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	91.92%	3'942'798.36	0.22	a)
CH0286864027	6.8750 % UBS 6 7/8 PERP	5'000	0	0	5'000 USD	98.96%	4'244'813.37	0.24	a)
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	2'800	0	0	2'800 USD	83.27%	2'000'200.81	0.11	a)
ILO060001943	5.0000 % ISRELE 5 11/12/24 6	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	3'000	0	0	3'000 USD	94.09%	2'421'444.81	0.14	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	10'000	0	0	10'000 USD	71.21%	6'108'765.46	0.35	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	3'540	0	0	3'540 USD	71.02%	2'156'814.34	0.12	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	91.44%	7'844'351.97	0.45	a)
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	5'000	0	0	5'000 USD	98.34%	4'218'253.00	0.24	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	5'800	4'200	0	10'000 USD	93.15%	7'991'270.62	0.45	a)
US00774MAX39	3.3000 % AER 3.3 01/30/32	4'000	0	0	4'000 USD	85.52%	2'934'440.46	0.17	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	0	1'000	0	1'000 USD	102.19%	876'632.05	0.05	a)
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	3'100	0	0	3'100 USD	98.76%	2'626'343.66	0.15	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	5'000	0	0	5'000 USD	60.61%	2'599'657.34	0.15	a)
US022095BM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	20'000	0	0	20'000 USD	73.88%	12'675'429.29	0.72	a)
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	10'000	0	0	10'000 USD	88.91%	7'627'031.54	0.43	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	10'000	0	0	10'000 USD	77.45%	6'643'822.72	0.38	a)
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	4'600	0	0	4'600 USD	92.14%	3'635'802.16	0.21	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	5'000	0	0	5'000 USD	98.54%	4'226'663.54	0.24	a)
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	1'450	0	0	1'450 USD	104.24%	1'296'596.16	0.07	a)
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	5'110	0	0	5'110 USD	75.34%	3'302'520.82	0.19	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	2'500	0	0	2'500 USD	88.99%	1'908'588.90	0.11	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	81.93%	3'514'261.15	0.20	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	3'400	0	0	3'400 USD	87.73%	2'558'815.76	0.15	a)
US03040WBA27	4.4500 % AVK 4.45 06/01/32	7'000	0	0	7'000 USD	98.35%	5'905'964.58	0.34	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	5'019	0	0	5'019 USD	88.89%	3'827'308.13	0.22	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	5'300	0	5'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	12'000	0	0	12'000 USD	72.19%	7'431'097.11	0.42	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	0	5'000	0	5'000 USD	103.09%	4'421'857.61	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US034863AX89	2.6250 % AALLN 2 5/8 09/10/30 144A	5'000	0	0	5'000 USD	85.45%	3'665'164.13	0.21	a)
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	10'080	1'920	0	12'000 USD	105.20%	10'829'907.08	0.61	a)
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	1'500	3'495	0	5'000 USD	96.42%	4'135'864.53	0.23	a)
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000	0	0	15'000 USD	82.51%	10'616'688.20	0.60	a)
US037833BW97	4.5000 % AAPL 4 1/2 02/23/36	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	4'000	0	0	4'000 USD	96.89%	3'324'851.19	0.19	a)
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	13'200	0	10'700	2'500 USD	64.99%	1'393'685.07	0.08	a)
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	0	5'000	0	5'000 USD	102.48%	4'395'434.80	0.25	a)
US04686E3K65	1.7300 % ATH 1.73 10/02/26 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	90.42%	3'878'130.75	0.22	a)
US052769AH94	2.4000 % ADSK 2.4 12/15/31	2'615	0	0	2'615 USD	84.51%	1'895'683.68	0.11	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	5'100	0	1'100	4'000 USD	98.23%	3'370'629.91	0.19	a)
US05578UAA25	5.7000 % BPCGP 5.7 10/22/23 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	5'000	0	0	5'000 USD	82.48%	3'537'788.54	0.20	a)
US06051GFH74	4.2000 % BAC 4.2 08/26/24 MTN	5'090	0	5'090	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	10'000	0	0	10'000 USD	94.54%	8'110'020.05	0.46	a)
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	10'000	0	0	10'000 USD	88.03%	7'551'274.81	0.43	a)
US06051GHX07	2.8840 % BAC 2.884 10/22/30 MTN	1'405	2'595	0	4'000 USD	89.06%	3'055'915.25	0.17	a)
US06051GJW06	3.3110 % BAC 3.311 04/22/42	7'000	0	0	7'000 USD	78.64%	4'722'588.90	0.27	a)
US06368EDC30	0.9490 % BMO 0.949 01/22/27 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	92.40%	3'963'251.52	0.22	a)
US06406GRAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	7'500	0	0	7'500 USD	96.20%	6'189'079.44	0.35	a)
US06407F2E11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	7'750	0	0	7'750 USD	92.68%	6'161'546.23	0.35	a)
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	8'000	0	0	8'000 USD	84.21%	5'778'820.74	0.33	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	6'000	0	0	6'000 USD	83.06%	4'274'968.79	0.24	a)
US06675FAZ09	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 144A	0	5'000	0	5'000 USD	99.82%	4'281'485.04	0.24	a)
US06738ECN31	9.6250 % BACR 9 5/8 PERP	0	2'200	0	2'200 USD	103.25%	1'948'606.28	0.11	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	6'000	0	0	6'000 USD	89.12%	4'586'908.99	0.26	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	0	5'000	0	5'000 USD	92.52%	3'968'501.60	0.23	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	5'000	0	0	5'000 USD	82.96%	3'558'302.78	0.20	a)
US0778FPAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	6'000	0	0	6'000 USD	76.32%	3'928'266.10	0.22	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	7'000	0	5'000	2'000 USD	85.19%	1'461'625.35	0.08	a)
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	0	5'000 USD	96.63%	4'144'843.22	0.24	a)
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	94.82%	4'066'895.28	0.23	a)
US10112RBF01	2.4500 % BXP 2.45 10/01/33	4'900	0	4'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122CP17	3.4000 % BMV 3.4 07/26/29	5'000	0	0	5'000 USD	94.69%	4'061'550.96	0.23	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	0	5'000	0	5'000 USD	78.53%	3'368'269.75	0.19	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	10'000	0	0	10'000 USD	91.97%	7'889'261.53	0.45	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	2'250	0	0	2'250 USD	82.00%	1'582'781.98	0.09	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'600	0	0	2'600 USD	91.10%	2'031'999.91	0.12	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	0	6'000	0	6'000 USD	89.18%	4'589'928.28	0.26	a)
US161175BX17	2.3000 % CHTR 2.3 02/01/32	6'000	0	0	6'000 USD	78.17%	4'023'478.19	0.23	a)
US161175CC60	4.4000 % CHTR 4.4 12/01/61	0	5'000	0	5'000 USD	67.25%	2'884'677.44	0.16	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	1'900	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33 144A	0	6'000	0	6'000 USD	102.19%	5'259'660.90	0.30	a)
US172967HB08	5.5000 % C 5 1/2 09/13/25	6'000	0	0	6'000 USD	100.62%	5'179'099.93	0.29	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	3'000	0	0	3'000 USD	98.48%	2'534'472.29	0.14	a)
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	6'000	0	0	6'000 USD	95.25%	4'902'481.65	0.28	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	3'700	0	0	3'700 USD	85.44%	2'711'943.76	0.15	a)
US191216DC18	2.5000 % KO 2 1/2 03/15/51	5'000	5'000	0	10'000 USD	65.12%	5'586'018.78	0.32	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	5'000	0	0	5'000 USD	89.75%	3'849'785.67	0.22	a)
US191241AJ70	1.8500 % KOF 1.85 09/01/32	2'250	0	0	2'250 USD	79.47%	1'533'954.23	0.09	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	0	1'300	0	1'300 USD	103.96%	1'159'412.39	0.07	a)
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	2'000	0	0	2'000 USD	96.53%	1'656'215.60	0.09	a)
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	9'242	0	0	9'242 USD	82.75%	6'560'539.42	0.37	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	10'000	0	0	10'000 USD	81.33%	6'976'971.51	0.40	a)
US219868CC84	2.3750 % CAF 2 3/8 05/12/23	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US224044CJ43	3.5000 % COXENT 3 1/2 08/15/27 144A	1'675	0	0	1'675 USD	95.38%	1'370'537.81	0.08	a)
US22822VAR24	3.3000 % CCI 3.3 07/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	89.33%	1'532'710.78	0.09	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	8'500	0	0	8'500 USD	82.52%	6'016'955.96	0.34	a)
US23355LAM81	2.3750 % DXC 2 3/8 09/15/28	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	93.51%	4'010'962.52	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	92.35%	3'960'987.86	0.22	a)
US24422EVP14	1.5000 % DE 1 1/2 03/06/28 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	89.06%	3'820'193.28	0.22	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	0	5'000	0	5'000 USD	100.66%	4'317'378.52	0.24	a)
US24703DBG51	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51 144A	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	0	8'000	5'109	2'891 USD	71.32%	1'768'747.32	0.10	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	8'000	2'000	0	10'000 USD	104.82%	8'992'407.56	0.51	a)
US249670AB66	3.3750 % DEPTCC 3 3/8 PERP D	3'250	0	0	3'250 USD	84.52%	2'356'511.81	0.13	a)
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	3'600	0	0	3'600 USD	83.88%	2'590'544.53	0.15	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	2'000	0	0	2'000 USD	94.72%	1'625'093.03	0.09	a)
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	4'118	0	0	4'118 USD	95.79%	3'384'002.74	0.19	a)
US25470DAR08	3.9500 % WBD 3.95 03/20/28	2'000	0	0	2'000 USD	95.56%	1'639'569.57	0.09	a)
US26442UAP93	4.0000 % DUK 4 04/01/52	2'250	0	0	2'250 USD	81.13%	1'565'998.49	0.09	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	6'100	0	0	6'100 USD	96.51%	5'050'328.69	0.29	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	3'500	0	0	3'500 USD	86.40%	2'594'001.43	0.15	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	2'300	0	0	2'300 USD	83.07%	1'638'961.66	0.09	a)
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	5'000	5'000	0	10'000 USD	80.56%	6'910'909.69	0.39	a)
US29274FAF18	4.0000 % ENELIM 4 10/25/26	0	4'000	0	4'000 USD	96.89%	3'324'798.03	0.19	a)
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	2'000	0	0	2'000 USD	91.33%	1'566'915.23	0.09	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	88.06%	3'021'637.34	0.17	a)
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	6'000	0	0	6'000 USD	92.52%	4'761'961.09	0.27	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	5'615	0	0	5'615 USD	93.70%	4'513'478.49	0.26	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	0	5'000	0	5'000 USD	104.41%	4'478'441.61	0.25	a)
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	0	1'100	0	1'100 USD	105.04%	991'183.55	0.06	a)
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	2'600	0	0	2'600 USD	101.48%	2'263'353.11	0.13	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	4'100	0	1'100	3'000 USD	101.61%	2'615'007.96	0.15	a)
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	1'700	0	1'700 USD	102.62%	1'496'570.93	0.08	a)
US375558BX02	1.2000 % GILD 1.2 10/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	89.01%	3'817'770.19	0.22	a)
US377373AH85	3.3750 % GSK 3 3/8 06/01/29	5'000	0	0	5'000 USD	95.76%	4'107'185.79	0.23	a)
US38141GWB66	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	10'000	0	0	10'000 USD	97.53%	8'366'621.34	0.47	a)
US38141GWQ36	3.2720 % GS 3.272 09/29/25	8'000	0	0	8'000 USD	98.51%	6'760'818.79	0.38	a)
US404280AW98	4.3000 % HSBC 4.3 03/08/26	4'000	0	0	4'000 USD	98.45%	3'378'209.53	0.19	a)
US404280DL07	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/02/36	3'000	0	0	3'000 USD	104.17%	2'680'927.13	0.15	a)
US437076CC49	3.3000 % HD 3.3 04/15/40	7'000	0	0	7'000 USD	81.80%	4'911'753.66	0.28	a)
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	1'750	0	0	1'750 USD	94.26%	1'415'135.02	0.08	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	3'300	0	0	3'300 USD	88.45%	2'503'793.93	0.14	a)
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	0	3'550	0	3'550 USD	104.62%	3'186'002.57	0.18	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	3'000	0	3'000 USD	100.41%	2'584'036.55	0.15	a)
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	82.26%	4'234'055.93	0.24	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	3'550	0	0	3'550 USD	97.06%	2'955'853.15	0.17	a)
US458140CA64	4.1500 % INTC 4.15 08/05/32	8'000	0	0	8'000 USD	96.42%	6'617'281.82	0.38	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	3'900	0	0	3'900 USD	91.29%	3'054'175.36	0.17	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	9'800	0	3'800	6'000 USD	98.16%	5'052'311.42	0.29	a)
US46647PAF36	3.5400 % JPM 3.54 05/01/28	8'000	0	0	8'000 USD	95.82%	6'575'599.57	0.37	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	89.00%	2'290'450.90	0.13	a)
US46647PBP09	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	7'000	0	0	7'000 USD	88.14%	5'292'497.15	0.30	a)
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	5'000	0	0	5'000 USD	77.42%	3'320'757.72	0.19	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	4'500	0	0	4'500 USD	85.91%	3'316'275.47	0.19	a)
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	0	8'000	0	8'000 USD	101.48%	6'964'148.66	0.40	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	12'000	0	7'000	5'000 USD	85.44%	3'664'538.71	0.21	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	5'100	0	0	5'100 USD	83.03%	3'632'567.63	0.21	a)
US48124BAC90	8.5491 % JPM FLOAT PERP Q	3'400	0	3'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	0	650	0	650 USD	101.58%	566'399.15	0.03	a)
US49456BAR24	2.0000 % KMI 2 02/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	82.35%	3'532'243.53	0.20	a)
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	10'000	5'000	0	15'000 USD	86.65%	11'149'825.98	0.63	a)
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US514886AC47	7.6250 % LBBW 7 5/8 02/01/23	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	0	5'000	0	5'000 USD	62.61%	2'685'399.36	0.15	a)
US53944YAF07	4.4500 % LLOYDS 4.45 05/08/25	7'000	3'000	0	10'000 USD	98.98%	8'490'588.82	0.48	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'400	0	0	4'400 USD	84.11%	3'174'903.97	0.18	a)
US55903VAC72	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24 144A	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAW37	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	10'000	0	0	10'000 USD	87.47%	7'503'786.29	0.43	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	5'000	0	0	5'000 USD	93.24%	3'999'181.28	0.23	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	101.40%	3'305'337.23	0.19	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	10'000	0	0	10'000 USD	82.56%	7'082'608.28	0.40	a)
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	87.31%	3'744'993.37	0.21	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	3'450	0	0	3'450 USD	93.18%	2'757'742.61	0.16	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	0	1'700	0	1'700 USD	99.28%	1'447'914.35	0.08	a)
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	8'000	0	0	8'000 USD	71.56%	4'910'725.61	0.28	a)
US58933YBM66	5.0000 % MRK 5 05/17/53	0	1'300	0	1'300 USD	100.17%	1'117'077.05	0.06	a)
US59156RBZ01	4.5500 % MET 4.55 03/23/30	5'000	0	0	5'000 USD	100.12%	4'294'447.11	0.24	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	2'100	0	0	2'100 USD	97.59%	1'758'011.98	0.10	a)
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	13'722	0	0	13'722 USD	66.61%	7'840'895.66	0.44	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	6'278	5'000	0	11'278 USD	71.86%	6'952'354.42	0.39	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	5'000	0	0	5'000 USD	83.83%	3'595'619.90	0.20	a)
US606822CN27	5.3540 % MUFG 5.354 09/13/28	0	5'000	0	5'000 USD	101.31%	4'345'465.90	0.25	a)
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	0	2'200	0	2'200 USD	107.83%	2'035'118.73	0.12	a)
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	5'000	3'000	0	8'000 USD	96.41%	6'616'106.29	0.38	a)
US61747YEK73	2.4750 % MS 2.475 01/21/28	8'000	0	0	8'000 USD	93.22%	6'397'500.99	0.36	a)
US61772BAC72	3.2170 % MS 3.217 04/22/42	8'000	0	0	8'000 USD	77.60%	5'325'255.89	0.30	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	8'000	0	0	8'000 USD	84.09%	5'770'762.99	0.33	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	2'700	0	0	2'700 USD	98.63%	2'284'374.86	0.13	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	4'000	0	4'000 USD	102.48%	3'516'562.37	0.20	a)
US637639AB13	1.5000 % NSCCLF 1 1/2 04/23/25 144A	5'000	0	0	5'000 USD	95.90%	4'113'583.12	0.23	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	91.81%	1'575'211.60	0.09	a)
US641062AS38	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 144A	5'000	0	0	5'000 USD	89.06%	3'820'075.11	0.22	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	0	6'000	0	6'000 USD	100.44%	5'169'912.56	0.29	a)
US64952XCS80	3.0000 % NYLIFE 3 01/10/28 REGS	7'850	0	0	7'850 USD	94.19%	6'343'004.67	0.36	a)
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	85.37%	3'661'922.40	0.21	a)
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	15'000	0	0	15'000 USD	82.28%	10'587'518.17	0.60	a)
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	91.77%	3'936'175.41	0.22	a)
US68389XBE40	3.9000 % ORCL 3.9 05/15/35	8'000	4'000	0	12'000 USD	88.64%	9'125'273.10	0.52	a)
US6944PM2E61	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	88.07%	7'554'656.03	0.43	a)
US713448CT37	2.7500 % PEP 2 3/4 04/30/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	0	10'000	0	10'000 USD	68.20%	5'850'664.30	0.33	a)
US71427QAA67	1.2500 % RIFP 1 1/4 04/01/28 144A	8'000	0	0	8'000 USD	87.19%	5'983'775.52	0.34	a)
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	6'000	0	6'000 USD	101.27%	5'212'349.53	0.30	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	8'500	0	0	8'500 USD	92.22%	6'724'667.02	0.38	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XCB55	2.2500 % PLD 2 1/4 01/15/32	3'000	0	0	3'000 USD	83.24%	2'142'258.33	0.12	a)
US744320AY89	3.9050 % PRU 3.905 12/07/47	7'753	0	0	7'753 USD	81.97%	5'451'562.17	0.31	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	6'000	0	0	6'000 USD	88.00%	4'529'431.48	0.26	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	6'800	0	0	6'800 USD	87.32%	5'093'779.81	0.29	a)
US747525BP77	1.6500 % QCOM 1.65 05/20/32	5'071	0	0	5'071 USD	80.19%	3'488'438.59	0.20	a)
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	4'000	0	0	4'000 USD	101.89%	3'496'195.57	0.20	a)
US775109BB60	5.0000 % RCICN 5 03/15/44	0	5'000	0	5'000 USD	93.59%	4'014'379.89	0.23	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	0	5'000	0	5'000 USD	83.86%	3'597'063.06	0.20	a)
US78081BAM54	3.5500 % RPRX 3.55 09/02/50	0	8'000	0	8'000 USD	70.70%	4'851'893.78	0.28	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	0	4'400	0	4'400 USD	100.47%	3'792'321.51	0.22	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	2'200	0	0	2'200 USD	88.96%	1'678'840.20	0.10	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	4'700	0	0	4'700 USD	97.92%	3'948'011.66	0.22	a)
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	4'000	0	0	4'000 USD	87.55%	3'004'159.89	0.17	a)
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	10'000	2'000	0	10'000 USD	96.61%	8'287'345.71	0.47	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	5'900	0	0	5'900 USD	103.35%	5'230'666.60	0.30	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	0	2'550	0	2'550 USD	99.97%	2'186'839.37	0.12	a)
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	6'000	0	0	6'000 USD	75.88%	3'905'867.93	0.22	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	0	2'500	0	2'500 USD	103.28%	2'214'912.21	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	100.81%	2'594'482.41	0.15	a)
US86964WAK80	3.1250 % SUZANO 3 1/8 01/15/32 DM3N	3'000	0	0	3'000 USD	82.12%	2'113'333.35	0.12	a)
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	0	5'000	0	5'000 USD	71.12%	3'050'516.02	0.17	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	91.03%	3'904'467.17	0.22	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	8'000	0	0	8'000 USD	85.70%	5'881'117.36	0.33	a)
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	4'900	0	0	4'900 USD	84.81%	3'564'753.25	0.20	a)
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	85.26%	3'657'202.72	0.21	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	5'550	0	0	5'550 USD	85.70%	4'080'032.45	0.23	a)
US891160MJ94	3.6250 % TD 3 5/8 09/15/31	4'000	0	2'000	2'000 USD	96.06%	1'648'109.52	0.09	a)
US912796ZY88	0.0000 % B 01/25/24	0	25'000	25'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FS14	0.0000 % B 06/13/24	0	10'000	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	0	20'000	20'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	14'000	0	0	14'000 USD	84.65%	10'166'138.83	0.58	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	2'666	0	0	2'666 USD	98.54%	2'253'526.89	0.13	a)
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	5'000	0	0	5'000 USD	96.10%	4'122'080.60	0.23	a)
US92343VFW90	2.9870 % VZ 2.987 10/30/56	0	5'000	0	5'000 USD	64.98%	2'787'155.51	0.16	a)
US92343VGK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	10'000	0	0	10'000 USD	79.06%	6'782'164.24	0.38	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	5'000	0	0	5'000 USD	73.05%	3'133'170.38	0.18	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	5'000	15'000	0	20'000 USD	70.73%	12'135'765.12	0.69	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000	0	0	10'000 USD	92.03%	7'894'874.45	0.45	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US928563AD71	4.5000 % VMW 4 1/2 05/15/25	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBU36	4.2500 % VOD 4 1/4 09/17/50	5'000	0	0	5'000 USD	82.11%	3'521'910.30	0.20	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	87.66%	3'007'901.72	0.17	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US958102AQ89	2.8500 % WDC 2.85 02/01/29	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	3'300	0	0	3'300 USD	88.56%	2'506'973.88	0.14	a)
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'600	0	0	2'600 USD	93.85%	2'093'284.39	0.12	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	0	2'100	0	2'100 USD	102.97%	1'854'900.90	0.11	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	2'200	0	0	2'200 USD	105.66%	1'994'019.84	0.11	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	4'200	0	4'200 USD	105.72%	3'808'987.82	0.22	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	0	2'500	0	2'500 USD	88.86%	1'905'713.78	0.11	a)
USF1067PAD80	9.2500 % BNP 9 1/4 PERP REGS	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	101.31%	4'345'482.07	0.25	a)
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	3'000	0	0	3'000 USD	80.26%	2'065'479.76	0.12	a)
USF84914CU62	7.3750 % SOCGEN 7 3/8 PERP REGS	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF8500RAA08	5.3750 % SOCGEN 5 3/8 PERP REGS	0	3'000	0	3'000 USD	81.43%	2'095'667.50	0.12	a)
USF8500RAB80	4.7500 % SOCGEN 4 3/4 PERP REGS	0	4'500	0	4'500 USD	88.83%	3'429'203.90	0.19	a)
USF8500RAC63	9.3750 % SOCGEN 9 3/8 PERP REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	6'500	0	0	6'500 USD	96.35%	5'372'332.81	0.30	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	0	3'800	0	3'800 USD	100.57%	3'278'443.63	0.19	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	4'900	0	0	4'900 USD	90.93%	3'822'336.83	0.22	a)
USG7420TAD84	2.7500 % RKTLN 2 3/4 06/26/24 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	98.94%	3'395'130.10	0.19	a)
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	81.13%	3'479'968.85	0.20	a)
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	8'800	0	0	8'800 USD	92.72%	6'999'576.73	0.40	a)
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	80.48%	2'623'576.38	0.15	a)
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	98.66%	1'354'153.97	0.08	a)
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	0	300	0	300 USD	107.03%	275'441.91	0.02	a)
USH4209UAT37	7.0000 % UBS 7 PERP REGS	6'000	0	0	6'000 USD	100.06%	5'150'291.20	0.29	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	102.22%	1'227'591.93	0.07	a)
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	95.56%	1'639'557.23	0.09	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	4'300	0	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN82008AX66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	93.18%	3'996'680.26	0.23	a)
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	91.80%	3'937'401.19	0.22	a)
USP0R80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	3'450	0	0	3'450 USD	92.80%	2'746'433.02	0.16	a)
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	6'000	0	0	6'000 USD	82.05%	4'223'195.55	0.24	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALC5W 5 3/8 12/06/32 REGS	800	0	0	800 USD	103.30%	708'899.79	0.04	a)
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'956	0	0	1'956 USD	88.09%	1'478'126.99	0.08	a)
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	7'000	5'000	0	12'000 USD	87.21%	8'977'983.59	0.51	a)
USU3149FAB59	2.3750 % FMEGR 2 3/8 02/16/31 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USU3644QAD70	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	4'500	5'000	0	9'500 USD	66.12%	5'388'173.01	0.31	a)
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	92.21%	3'954'994.32	0.22	a)
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	6'000	0	0	6'000 USD	80.22%	4'129'158.03	0.23	a)
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	92.25%	3'165'536.67	0.18	a)
USY3815NBF79	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 01/24/27 REGS	4'300	0	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	106.82%	4'581'568.09	0.26	a)
USY68856AN67	3.5000 % PETMK 3 1/2 03/18/25 REGS	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY68856AV83	4.5500 % PETMK 4.55 04/21/50 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	82.75%	2'484'665.13	0.14	a)
X51253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	8'000	0	3'000	5'000 USD	97.93%	4'200'672.96	0.24	a)
X51550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	98.75%	4'235'614.00	0.24	a)
X51650033571	5.0000 % BOAD 5 07/27/27 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	94.03%	3'226'614.05	0.18	a)
X51681539539	4.1250 % STOAU 4 1/8 09/14/27 EMTN	1'200	0	0	1'200 USD	95.56%	983'729.40	0.06	a)
X51888180640	6.2500 % VOD 6 1/4 10/03/2078	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51951093894	7.5000 % SANTAN 7 1/2 PERP	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51956051145	6.7500 % INTNED 6 3/4 PERP	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52049422343	4.2500 % SRENVX 4 1/4 PERP	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	7'200	0	0	7'200 USD	98.44%	6'080'351.58	0.34	a)
X52076169668	5.1250 % SEB 5 1/8 PERP	3'800	0	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52233263404	4.3750 % SHBASS 4 3/8 PERP	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52283175516	1.4560 % STANLN 1.456 01/14/27 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	92.30%	3'958'891.97	0.22	a)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	10'000	0	0	10'000 USD	81.69%	7'008'158.14	0.40	a)
X52403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	14'300	0	0	14'300 USD	88.49%	10'855'200.72	0.62	a)
X52416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	5'900	0	0	5'900 USD	82.52%	4'176'421.97	0.24	a)
X52465969132	3.5000 % KORWAT 3 1/2 04/27/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	0	6'000	0	6'000 USD	99.33%	5'112'357.08	0.29	a)
USD							1'052'345'302.20	59.71	

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

93'376'968.16 5.30

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

93'376'968.16 5.30

1U2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	1'002	0	1'002	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	0	1'002	0	1'002 CHF	93'153.40	93'376'968.16	5.30	a)

CHF 93'376'968.16 5.30

Derivative Finanzinstrumente

8'035'074.97 0.46

Futures

0.00 0.00

03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	-500	500	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	800	800	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	0	100	-100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR NOTE (CBT)MAR24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	

Devisentermingeschäfte

EUR/CHF Verfall 24.02.2023	169'309'576	172'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 24.02.2023	500'553'130	539'000'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 24.02.2023	6'872'334	7'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 24.02.2023	6'411'811	7'000'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 24.02.2023	9'157'040	10'000'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 24.02.2023	10'003'410	10'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 24.02.2023		3'704'416	4'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.03.2023		239'218'320	240'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.03.2023		40'335'409	59'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.03.2023		10'421'633	16'300'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.03.2023		53'876'976	48'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.03.2023		14'162'507	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.03.2023		564'244'050	615'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.04.2023		182'335'815	185'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.04.2023		484'483'125	525'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.04.2023		7'969'512	8'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.05.2023		13'874'001	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.05.2023		40'510'320	60'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		579'017'884	628'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.05.2023		53'168'139	47'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.05.2023		222'600'672	224'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.05.2023		10'266'834	16'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		14'000'000	12'407'794		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.05.2023		12'000'000	11'760'480		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.06.2023		201'763'198	206'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.06.2023		507'089'100	570'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.06.2023		17'638'660	20'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 20.07.2023		12'830'807	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.07.2023		206'081'334	213'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 20.07.2023		9'855'403	16'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 20.07.2023		39'754'200	60'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 20.07.2023		52'262'543	47'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.07.2023		540'952'885	605'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 20.07.2023		2'275'704	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 20.07.2023		3'000'000	2'927'514		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.07.2023		1'000'000	897'117		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 20.07.2023		7'000'000	6'830'705		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 20.07.2023		5'000'000	4'874'320		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.08.2023		534'381'600	600'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.08.2023		205'271'430	210'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.08.2023		8'544'290	10'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 24.08.2023		5'000'000	4'787'865		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.09.2023		12'270'362	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.09.2023		9'668'006	16'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.09.2023		54'693'996	49'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		195'243'573	203'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.09.2023		38'795'820	60'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		539'757'201	633'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		3'000'000	2'617'941		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.09.2023		2'857'002	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.10.2023		195'844'085	205'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.10.2023		496'864'440	570'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.10.2023		13'096'395	15'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.10.2023		5'731'194	6'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.10.2023		20'000'000	18'039'280		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		196'801'070	206'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		55'223'500	50'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		12'005'377	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		39'123'903	59'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		9'616'962	16'700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		526'268'790	590'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.12.2023		479'555'925	541'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.12.2023		192'112'298	203'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.12.2023		9'054'260	10'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.12.2023		9'624'890	10'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.12.2023		26'494'920	30'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.12.2023		6'729'331	7'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.12.2023		26'164'350	30'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		9'540'242	16'700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		11'751'405	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		213'413'262	222'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		38'252'650	59'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		50'618'216	46'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		545'774'320	610'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		644'803	1'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		2'200'352	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		2'173'166	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		1'936'227	3'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		2'828'286	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		6'887'208	8'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		5'000'000	4'274'855		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		5'000'000	4'262'905		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		7'000'000	5'935'937		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		16'000'000	13'602'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		5'000'000	4'260'500		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		226'742'640	240'000'000		CHF/EUR	3'404'954.69	0.19	b)
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		561'582'596	652'000'000		CHF/USD	3'524'438.41	0.20	b)
	CHF/USD Verfall 22.02.2024		15'000'000	12'880'785		USD/CHF	-42'062.33	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 21.03.2024		11'597'843	1'970'000'000		CHF/JPY	8'432.64	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		219'211'525	235'000'000		CHF/EUR	915'867.29	0.05	b)
	GBP/CHF Verfall 21.03.2024		54'032'650	50'000'000		CHF/GBP	-320'032.49	-0.02	b)
	CAD/CHF Verfall 21.03.2024		44'385'040	70'000'000		CHF/CAD	-354'561.24	-0.02	b)
	AUD/CHF Verfall 21.03.2024		9'612'650	17'000'000		CHF/AUD	7'279.08	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		517'213'290	605'000'000		CHF/USD	890'758.92	0.05	b)
Devisentermingeschäfte							8'035'074.97	0.46	

	Kurswert CHF	in % 7)
Vermögensaufstellung		
Bankguthaben auf Sicht	30'161'808.06	1.71
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'612'015'134.08	91.46
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	93'376'968.16	5.30
Derivative Finanzinstrumente	8'035'074.97	0.46
Sonstige Vermögenswerte	18'930'518.30	1.07
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'762'519'503.57	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-308'501.44	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'762'211'002.13	

	Kurswert CHF	in % 7)
Bewertungskategorien		
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'705'392'102.24	96.76
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	8'035'074.97	0.46
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	137'909'455.31	7.82
------------------------------	-----------------------	-------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				137'909'455.31	7.82
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	2'900 AUD	99.18%	1'631'035.40	0.09
CH0286864027	6.8750 % UBS 6 7/8 PERP	500 USD	98.96%	424'481.34	0.02
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	500 CHF	99.50%	497'500.00	0.03
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	2'000 CHF	90.31%	1'806'120.00	0.10
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	1'000 EUR	79.08%	736'888.12	0.04
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	1'000 EUR	107.84%	1'004'931.30	0.06
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	1'000 EUR	84.38%	786'294.16	0.04
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'400 EUR	94.57%	1'233'708.69	0.07
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	1'600 USD	83.27%	1'142'971.89	0.06
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	1'000 EUR	93.77%	873'756.47	0.05
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	2'300 EUR	88.60%	1'898'985.06	0.11
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	2'000 USD	88.91%	1'525'406.31	0.09
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	450 USD	104.24%	402'391.91	0.02
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	1'000 USD	82.51%	707'779.21	0.04
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	2'300 USD	102.48%	2'021'900.01	0.11
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	1'000 USD	98.23%	842'657.48	0.05
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	3'000 USD	96.20%	2'475'631.78	0.14
US06738ECN31	9.6250 % BACR 9 5/8 PERP	2'000 USD	103.25%	1'771'460.25	0.10
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	1'000 USD	85.19%	730'812.67	0.04
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	1'900 USD	94.82%	1'545'420.21	0.09
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	2'000 USD	94.69%	1'624'620.38	0.09
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	1'000 USD	91.97%	788'926.15	0.04
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	680 USD	71.32%	416'031.88	0.02
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	6'000 USD	104.82%	5'395'444.54	0.31

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.01.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	1'000 USD	86.40%	741'143.26	0.04	
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	1'000 USD	105.04%	901'075.95	0.05	
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	400 USD	101.61%	348'667.73	0.02	
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	1'000 USD	88.45%	758'725.43	0.04	
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	2'400 USD	104.62%	2'153'917.23	0.12	
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'000 USD	97.06%	832'634.69	0.05	
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	2'700 USD	91.29%	2'114'429.10	0.12	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	500 USD	98.16%	421'025.95	0.02	
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	1'000 USD	89.00%	763'483.63	0.04	
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	2'300 USD	77.42%	1'527'548.56	0.09	
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	1'000 USD	101.48%	870'518.58	0.05	
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	2'000 USD	85.44%	1'465'815.48	0.08	
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	1'100 USD	96.41%	909'714.62	0.05	
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	2'033 USD	98.63%	1'720'049.66	0.10	
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	3'000 USD	102.48%	2'637'421.78	0.15	
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	1'100 USD	91.81%	866'366.38	0.05	
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	1'000 USD	100.44%	861'652.09	0.05	
US64952XCS80	3.0000 % NYLIFE 3 01/10/28 REGS	1'000 USD	94.19%	808'026.07	0.05	
US6944PM2E61	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 REGS	1'000 USD	88.07%	755'465.60	0.04	
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	1'000 USD	68.20%	585'066.43	0.03	
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	1'000 USD	101.89%	874'048.89	0.05	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	5'900 USD	103.35%	5'230'666.60	0.30	
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	1'000 USD	75.88%	650'977.99	0.04	
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	1'050 USD	103.28%	930'263.13	0.05	
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	1'800 USD	85.26%	1'316'592.98	0.07	
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	1'000 USD	92.03%	789'487.44	0.04	
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	1'100 USD	93.85%	885'620.32	0.05	
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	1'000 USD	88.86%	762'285.51	0.04	
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	1'000 USD	80.26%	688'493.25	0.04	
USF8500RAA08	5.3750 % SOCGEN 5 3/8 PERP REGS	2'990 USD	81.43%	2'088'681.94	0.12	
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	2'500 USD	96.35%	2'066'281.85	0.12	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	1'000 USD	90.93%	780'068.74	0.04	
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	4'270 USD	81.13%	2'971'893.40	0.17	
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	3'800 USD	92.72%	3'022'544.50	0.17	
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	1'600 USD	80.48%	1'104'663.74	0.06	
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	300 USD	107.03%	275'441.91	0.02	
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	2'000 USD	95.56%	1'639'557.23	0.09	
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	3'700 USD	91.80%	2'913'676.88	0.17	
USPOR80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	686 USD	92.80%	546'102.33	0.03	
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'181 USD	88.09%	892'468.29	0.05	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	1'300 USD	66.12%	737'328.94	0.04	
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	2'600 USD	80.22%	1'789'301.81	0.10	
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	1'100 USD	92.25%	870'522.59	0.05	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	2'200 USD	106.82%	2'015'889.96	0.11	
XS1245292807	4.3750 % SLHNXV 4 3/8 PERP	1'000 EUR	99.38%	926'088.49	0.05	
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	2'000 EUR	97.85%	1'823'644.10	0.10	
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	6'500 GBP	94.74%	6'727'145.50	0.38	
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	1'500 USD	98.75%	1'270'684.20	0.07	
XS1693822634	4.7500 % ABNANV 4 3/4 PERP	2'900 EUR	92.13%	2'489'521.51	0.14	
XS1793250041	4.7500 % SANTAN 4 3/4 PERP	2'200 EUR	93.55%	1'917'897.65	0.11	
XS1877860533	4.6250 % RABOBK 4 5/8 PERP	4'000 EUR	96.84%	3'609'530.13	0.20	
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	1'000 EUR	85.46%	796'348.69	0.05	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	1'100 EUR	92.55%	948'606.35	0.05	
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	500 USD	98.44%	422'246.64	0.02	
XS2109819859	2.5020 % TELEFO 2.502 PERP	1'000 EUR	93.25%	868'929.55	0.05	
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	1'000 EUR	93.92%	875'191.50	0.05	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'000 EUR	93.41%	870'439.13	0.05	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	100 EUR	94.75%	88'291.64	0.01	
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	500 EUR	85.95%	400'471.33	0.02	
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	5'000 EUR	88.58%	4'127'296.56	0.23	
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	500 EUR	87.23%	406'397.82	0.02	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.01.2024 rung	Wäh- rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'200	EUR	86.35%	965'570.46	0.05	
XS2388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	1'000	EUR	76.52%	713'051.70	0.04	
XS2405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	1'000	EUR	89.90%	837'722.30	0.05	
XS2462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	600	EUR	108.58%	607'084.96	0.03	
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	1'100	EUR	91.63%	939'247.91	0.05	
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	1'000	USD	99.33%	852'059.51	0.05	
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	400	EUR	105.35%	392'676.50	0.02	
XS2598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	1'900	EUR	102.53%	1'815'303.22	0.10	
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	1'400	EUR	105.60%	1'377'681.38	0.08	
XS2711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	1'000	EUR	106.91%	996'246.57	0.06	
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	2'400	EUR	102.66%	2'295'944.29	0.13	
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	1'800	EUR	101.99%	1'710'753.80	0.10	
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	4'000	EUR	101.06%	3'766'787.10	0.21	
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	2'000	EUR	101.94%	1'899'831.17	0.11	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56708174
CAD	1 = CHF	0.64207926
EUR	1 = CHF	0.93183793
GBP	1 = CHF	1.09242908
JPY	100 = CHF	0.58686500
USD	1 = CHF	0.85785000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
Bond	CHF	150'263'388.10	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	1'664'272'289.53	94.442
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	9'066.25	0.001
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	137'909'455.31
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000
BA CHF	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000
CT CHF	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000
DA CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
DT CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000
MT CHF	-	-	-	-	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

9 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

10 TER

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

11 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 29.04.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 02.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Ja	CHF	1.60000	0.56000	1.04000
BA CHF	Ja	CHF	1.95000	0.68250	1.26750
DA CHF	Ja	CHF	2.10000	0.73500	1.36500

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 29.04.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 02.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Ja	CHF	2.145	0.750	1.395
DT CHF	Ja	CHF	2.240	0.784	1.456
GT CHF	Ja	CHF	2.549	0.892	1.657
MT CHF	Ja	CHF	2.635	0.922	1.713
NT CHF	Ja	CHF	3.002	1.050	1.952

13 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-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 gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern 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 offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

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

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend

hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zu-zurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteils-klassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapital-erträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate

ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Effektenfonds"
(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR

(nachfolgend „die Teilvermögen“)

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

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR wird angepasst, vgl. Ziff. 1 dieser Mitteilung.

Die Anlagepolitik erfährt generell und bezogen auf die Teilvermögen Anpassungen und Ergänzungen, vgl. Ziff. 2 der Mitteilung.

Das Klassenkonzept wird angepasst, vgl. Ziff. 3 dieser Mitteilung.

Schliesslich erfolgt betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen eine Präzisierung, vgl. Ziff. 4 dieser Mitteilung.

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

1. Namensänderung

Bezeichnung bisher	Bezeichnung neu
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR	Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst, vgl. § 1 Ziff. 1, § 6 Ziff. 4 Überschrift zum Klassenkonzept dieses Teilvermögens, § 12 Überschrift zu den Ziff. 9 bis 19, § 19 Ziff. 1 sowie § 20 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages.

Die Namensänderung bringt die Repositionierung des Teilvermögens zum Ausdruck, welche unter Ziff. 2.2 und Ziff. 2.3 dieser Mitteilung erläutert wird.

2. Anpassung Anlagepolitik

2.1. Generelle Anpassungen

Neu wird § 8 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages mit der Überschrift "Zulässige Anlagen" und § 8 Ziff. 2 Bst. d des geänderten Fondsvertrages mit der Überschrift "Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters" versehen.

Die Bestimmung unter § 8 Ziff. 2 Bst. e des geänderten Fondsvertrages wird neu in § 8 Ziff. 3 eingeordnet und mit der Überschrift "Liquiditätsmanagement" versehen.

2.2. Teilfondsspezifische Anpassungen

Unter § 8 Ziff. 2 ist die Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen dargelegt. Unter § 8 Ziff. 2 Bst. a wird die Vermögensallokation für mindestens zwei Drittel des Vermögens der Teilvermögen definiert.

Die Anlageinstrumente Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte (inkl. Contingent Convertible Bonds) werden neu unter Forderungswertpapieren und -wertrechten eingeordnet. Zudem werden bei der beispielhaften Aufzählung neu auch Bail-in Bonds als zulässige Anlage aufgeführt und die Reihenfolge geändert, vgl § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Bezogen auf Ziff. 1 dieser Mitteilung bringt die neue Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) zum Ausdruck, dass das Teilvermögen weiterhin global in Unternehmensanleihen investiert, jedoch keine Beschränkung mehr auf Anleihen hat, die auf die Rechnungswährung des Teilvermögens lauten, welche bei diesem Teilvermögen der Euro (EUR) ist. Die Beschränkung auf die Rechnungswährung wird ersatzlos gestrichen, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF investieren ebenfalls global in Unternehmensanleihen, jedoch werden bei diesen Anleihen die Risiken von Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung abgesichert. Die Rechnungswährung dieser beiden Teilvermögen ist der Schweizer Franken (CHF). Neu wird in der Bestimmung die Rechnungswährung Schweizer Franken (CHF) explizit erwähnt, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Weiter wird betreffend indirekten Anlagen über strukturierte Produkte betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) die Auflage gestrichen, dass diese auf die Rechnungswährung lauten müssen. Auch bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF wird die Auflage gestrichen, dass diese gegen die Risiken von Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung abgesichert sein müssen, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. ad des geänderten Fondsvertrages.

Die angepasste Bestimmung von § 8 Ziff. 2 Bst. a des geänderten Fondsvertrages lautet wie folgt:

"a) Die Fondsleitung investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens des Teilvermögens in:

- aa) Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -wertrechte) von in- und ausländischen nicht staatlichen Emittenten (Nicht-Regierungs-Anleihen), welche bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF gegen die Risiken von Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung (Schweizer Franken (CHF)) abgesichert sind;*
- ab) Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen, die gemäss ihren Dokumenten ihr Vermögen gemäss den Richtlinien dieses Teilvermögens oder Teilen davon anlegen;*
- ac) Derivate (einschliesslich Warrants) auf die oben erwähnten Anlagen;*
- ad) strukturierte Produkte wie namentlich Zertifikate von Emittenten weltweit auf die oben erwähnten Anlagen.*

Bei Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen gemäss Bst. ab vorstehend, Derivaten gemäss Bst. ac vorstehend und strukturierten Produkten gemäss Bst. ad vorstehend, stellt die Fondsleitung sicher, dass auf konsolidierter Basis mindestens zwei Drittel des Vermögens des Teilvermögens in Anlagen gemäss Bst. aa vorstehend investiert sind. "

2.3. Ergänzung um Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable"

Bezogen auf Ziff. 1 und Ziff. 2.2 dieser Mitteilung bringt die Namensänderung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) zusätzlich zum Ausdruck, dass bei diesem Teilvermögen die Titelauswahl nicht mehr nach der Nachhaltigkeitspolitik "Responsible", sondern neu nach der Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" erfolgen wird.

Das hat zur Folge, dass die bestehende Bestimmung unter § 8 Ziff. 2 Bst. d in Bst. da Nachhaltigkeitspolitik "Responsible" und in Bst. db Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" unterteilt wird.

Unter Bst. da wird neu darauf hingewiesen, dass der Vermögensverwalter diese Nachhaltigkeitspolitik nicht mehr für jedes der Teilvermögen anwendet, sondern für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF. Ansonsten wird an der Nachhaltigkeitspolitik "Responsible" nichts geändert.

Unter Bst. db wird die Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" aufgeführt, welche der Vermögensverwalter neu beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) anwenden wird.

Die Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" lautet wie folgt, vgl. § 8 Ziff. 2 lit. db des geänderten Fondsvertrages:

*"Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate wendet der Vermögensverwalter eine Nachhaltigkeitspolitik an, welche **Ausschlüsse, Anlagen in SDG Titel**, einen **Best-in-Class-Ansatz**, einen **ESG-Integration-Ansatz** und die Ausrichtung auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** beinhaltet.*

*Der Vermögensverwalter legt umfangreiche **Ausschlusskriterien** fest. Die anwendbaren Ausschlusskriterien werden im Prospekt aufgeführt.*

*Der Vermögensverwalter fokussiert sich zudem auf Titel von Unternehmungen und zweckgebundene Finanzierungen (zum Beispiel Social, Green oder Sustainable Bonds), die gemäss Einschätzung des Vermögensverwalters einen Beitrag zur Erfüllung von wesentlichen Nachhaltigkeitszielen mit Bezug zu einem oder mehreren der 17 Nachhaltigkeitsziele der Vereinten Nationen (UN Sustainable Development Goals, UN SDGs) leisten (**Anlagen in SDG Titel**). Weitergehende Informationen zu den Anlagen in SDG Titel werden im Prospekt angegeben.*

*Zwecks Diversifikation kann der Vermögensverwalter zudem in Titel investieren, die er hinsichtlich der Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) als überdurchschnittlich positiv einschätzt (**Best-in-Class-Ansatz**). Weitergehende Informationen zum Best-in-Class-Ansatz werden im Prospekt angegeben.*

*Bei der Auswahl von Anlagen, welche nach Massgabe der SDG Analyse oder des Best-in-Class-Ansatzes als investierbar gelten, werden vom Vermögensverwalter schliesslich Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) systematisch berücksichtigt (**ESG-Integration-Ansatz**). Weitergehende Informationen zum ESG-Integration-Ansatz werden im Prospekt angegeben.*

*Des Weiteren richtet der Vermögensverwalter die Anlagetätigkeit auf eine kontinuierliche **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zur CO₂e-Intensität der Anlagen im Referenzindex per Ende 2019 aus. Weitere Informationen zur Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen finden sich im Prospekt.*

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten). Weitere Informationen finden sich im Prospekt bei den Erläuterungen der einzelnen Nachhaltigkeitsaspekte.

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik bei allen Anlagen angewendet wird. Der Vermögensverwalter behält sich dabei jedoch im Umfang von höchstens 33% des Vermögens des Teilvermögens vor, die Nachhaltigkeitspolitik oder einzelne Elemente der Nachhaltigkeitspolitik bei geldnahen Mitteln (einschliesslich flüssige Mittel) und/oder beim Einsatz von Derivaten auf Finanzindizes in Zusammenhang mit der Bewirtschaftung von Zeichnungen von Fondsanteilen durch Anleger und/oder beim Einsatz von engagementreduzierenden Derivaten nicht anzuwenden. Im Umfang von höchstens 33% des Vermögens des Teilvermögens (nach Abzug der flüssigen Mittel in Form von Bankguthaben) behält sich der Vermögensverwalter bei indirekten Anlagen über kollektive Kapitalanlagen oder über engagementerhöhende Derivate (mit Ausnahme von engagementerhöhenden Derivaten, denen Beteiligungs- oder Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen zugrunde liegen) aus Praktikabilitätsgründen überdies vor, die Nachhaltigkeitspolitik ebenfalls nicht anzuwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben überdies, dass die vorerwähnten Ausnahmen insgesamt 39% des Vermögens des Teilvermögens nicht übersteigen dürfen.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Verbesserung des Rendite-/Risikoprofils, die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit) sowie die Leistung eines Beitrages zu wesentlichen Nachhaltigkeitszielen.

Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik."

3. Anpassung Klassenkonzept

Fünf lancierte Anteilsklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) werden auf Anteilsklassen mit einer systematischen Währungsabsicherung umgestellt. Das heisst, dass neu bei diesen Anteilsklassen Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung dieser Anteilsklassen EUR und den Anlagewährungen des Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

Diese Währungsabsicherung kommt in der geänderten Bezeichnung der Anteilsklassen an dritter und vierter Stelle der Bezeichnung zum Ausdruck, indem die Bezeichnung dieser Anteilsklasse um "H1" ergänzt wird. Somit lauten die Bezeichnungen dieser Anteilsklassen bisher und neu wie folgt, vgl. § 6 Ziff. 4 und § 19 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages:

Bezeichnung bisher	Bezeichnung neu
AA EUR	AAH1 EUR
BA EUR	BAH1 EUR
CT EUR	CTH1 EUR
DA EUR	DAH1 EUR
GT EUR	GTH1 EUR

4. Präzisierung Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen wird mit Bezug auf die Tabelle am Ende des Prospektes eine Präzisierung vorgenommen. Der Text lautet neu wie folgt, vgl. neuen Wortlaut unter § 17 Ziff. 1 und erster Abschnitt von Ziff. 2 des geänderten Fondsvertrages:

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

2. *Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gemäss § 16 berechneten Nettoinventarwert je Anteil. Bei der Ausgabe von Anteilen kann zum Nettoinventarwert eine Ausgabekommission gemäss § 18 zugeschlagen werden.*"

* * *

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in dieser Mitteilung von den Ziff. 1, Ziff. 2 und Ziff. 3 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

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

Zürich, 8. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich