

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE SHORT DURATION 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
AT CHF	120551300	CHF
DT CHF	118413313	CHF
NT CHF	112379850	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	16
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	16
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
8	Pauschale Verwaltungskommission	17
9	Benchmark	18
10	TER	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

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	23.07.2021
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
Konsolidiert				
	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		321'710'046.40	308'648'295.95	44'089'817.25
Klasse AT CHF				
	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		144'280.20	104'605.94	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'452.078	1'062.078	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.3612	98.4918	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.4307	98.6001	
Thesaurierung je Anteil		1.80	0.84	
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	
Klasse DT CHF				
	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'267'613.44	15'515'936.98	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		124'360.944	158'994.346	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.6452	97.5880	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		98.7143	97.6953	
Thesaurierung je Anteil		2.18	1.41	
Total Expense Ratio (TER)		0.39 %	0.40 %	
Klasse NT CHF				
	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		309'298'152.76	293'027'753.03	44'089'817.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'348'013.504	3'205'825.659	450'755.270
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.3826	91.4048	97.8132
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.4473	91.5053	97.8132
Thesaurierung je Anteil		2.39	2.37	1.45
Total Expense Ratio (TER)		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 AT CHF (Lancierung 08.08.2022)	1.15 %	2.27 %	-2.65 %	-
Klasse DT CHF (Lancierung 05.05.2022)	1.60 %	2.69 %	-3.47 %	-
Klasse NT CHF (Lancierung 23.07.2021)	2.00 %	3.09 %	-8.20 %	-1.02 %
Benchmark	1.46 %	2.63 %	-8.53 %	-1.01 %
Tracking Error 33)	0.35 %	0.35 %	1.75 %	1.17 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse AT CHF (Lancierung 08.08.2022)	-0.31 %
Klasse DT CHF (Lancierung 05.05.2022)	0.14 %
Klasse NT CHF (Lancierung 23.07.2021)	0.54 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	4'907'691.03	3'660'921.73
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	312'986'495.12	301'523'036.58
Derivative Finanzinstrumente	701'214.42	848'445.87
Sonstige Vermögenswerte	3'118'640.70	2'667'448.43
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	321'714'041.27	308'699'852.61
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-46'333.62
Andere Verbindlichkeiten	-3'994.87	-5'223.04
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	321'710'046.40	308'648'295.95

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AT CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	Lancierung 08.08.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'062.078	-
Ausgegebene Anteile		390.000	1'062.078
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'452.078	1'062.078

Klasse DT CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	Lancierung 05.05.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		158'994.346	-
Ausgegebene Anteile		109'675.801	165'443.346
Zurückgenommene Anteile		-144'309.203	-6'449.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		124'360.944	158'994.346

Klasse NT CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'205'825.659	450'755.270
Ausgegebene Anteile		364'209.115	2'129'310.801
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	628'774.588
Zurückgenommene Anteile		-222'021.270	-3'015.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'348'013.504	3'205'825.659

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		308'648'295.95	44'089'817.25
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'739'553.08	-240'488.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		9'679'586.79	262'774'799.63
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		6'121'716.74	2'024'167.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		321'710'046.40	308'648'295.95

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		103'110.08	5'959.06
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-3'845.01
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		7'821'626.09	5'102'470.91
Erträge aus Wertpapierleihe		43'600.60	30'612.95
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		959'493.67	2'741'597.45
Total Ertrag		8'927'830.44	7'876'795.36
Aufwand			
Passivzinsen		-26.26	-80.18
Reglementarische Vergütungen		-67'890.36	-31'871.94
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-553'154.63	-8'817.53
Total Aufwand		-621'071.25	-40'769.65
Nettoertrag / Verlust		8'306'759.19	7'836'025.71
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'190'935.84	7'874'966.38
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		58'847.07	237'992.37
Realisierter Erfolg		10'556'542.10	15'948'984.46
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-4'434'825.36	-13'924'816.72
Gesamterfolg		6'121'716.74	2'024'167.74

Verwendung des Erfolges

Klasse AT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	2'623.85	894.08
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'623.85	894.08
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	918.35	312.93
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'705.50	581.15
Total	2'623.85	894.08
Klasse DT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	272'020.40	225'710.37
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	272'020.40	225'710.37
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	95'207.14	78'998.63
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	176'813.26	146'711.74
Total	272'020.40	225'710.37
Klasse NT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	8'032'114.94	7'609'421.26
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'032'114.94	7'609'421.26
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'811'240.23	2'663'297.44
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	5'220'874.71	4'946'123.82
Total	8'032'114.94	7'609'421.26

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							312'986'495.12	97.29	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							312'986'495.12	97.29	
AU3CB0291466	5.9060 % ANZ 5.906 08/12/32	0	2'500	0	2'500 AUD	101.71%	1'441'989.63	0.45	a)
AU3CB0297562	4.9000 % TLSAU 4.9 03/08/28 MTN	0	1'760	0	1'760 AUD	101.56%	1'013'603.72	0.32	a)
AUD							2'455'593.35	0.76	
CA06368LHJ85	7.0570 % BMO 7.057 PERP	0	1'000	0	1'000 CAD	100.55%	645'617.12	0.20	a)
CA06369ZCF95	2.0770 % BMO 2.077 06/17/30	3'000	0	0	3'000 CAD	95.85%	1'846'394.01	0.57	a)
CA06415ELY90	3.8900 % BNS 3.89 01/18/29	200	0	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA06415FFT45	1.8500 % BNS 1.85 11/02/26	1'200	0	0	1'200 CAD	93.15%	717'742.05	0.22	a)
CA07813ZBZ68	3.3500 % BCECN 3.35 03/12/25 MTN	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA07813ZCA09	3.8000 % BCECN 3.8 08/21/28 MTN	0	2'000	0	2'000 CAD	97.36%	1'250'268.55	0.39	a)
CA13607HC349	2.2500 % CM 2 1/4 01/07/27	1'600	0	0	1'600 CAD	93.53%	960'821.03	0.30	a)
CA775109BU44	3.1000 % RCICN 3.1 04/15/25	800	0	0	800 CAD	97.65%	501'595.67	0.16	a)
CA780086RA47	2.7400 % RY 2.74 07/25/29	2'000	0	0	2'000 CAD	98.67%	1'267'104.89	0.39	a)
CA87971MAR49	3.3500 % TCN 3.35 04/01/24 MTN	1'000	0	1'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA87971MBQ56	2.3500 % TCN 2.35 01/27/28 CAC	0	1'000	0	1'000 CAD	92.13%	591'534.51	0.18	a)
CA89117FWS42	3.1050 % TD 3.105 04/22/30 MTN	2'000	0	0	2'000 CAD	97.42%	1'250'994.70	0.39	a)
CA89117FYZ66	1.1280 % TD 1.128 12/09/25	2'300	0	0	2'300 CAD	93.93%	1'387'073.65	0.43	a)
CAD							10'419'146.18	3.24	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	99.50%	995'000.00	0.31	a)
CH0418609621	0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	2'000	0	0	2'000 CHF	96.55%	1'931'000.00	0.60	a)
CHF							2'926'000.00	0.91	
BE0002631126	1.1250 % KBCBB 1 1/8 01/25/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	0	2'500	500	2'000 EUR	100.95%	1'881'380.78	0.58	a)
BE0974423569	2.8750 % KBCBB 2 7/8 06/29/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6301510028	1.1500 % ABIBB 1.15 01/22/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.07%	885'916.96	0.28	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	98.01%	2'739'911.02	0.85	a)
DE000A13R7Z7	3.3750 % ALVGR 3 3/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1ZOTA4	1.6250 % JABHOL 1 5/8 04/30/25	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DAHNE	3.0990 % ALVGR 3.099 07/06/47	0	2'500	0	2'500 EUR	97.93%	2'281'325.62	0.71	a)
DE000CZ40MC5	1.1250 % CMZB 1 1/8 09/19/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	1'500	0	0	1'500 EUR	97.92%	1'368'697.53	0.43	a)
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	105.35%	490'864.27	0.15	a)
DE000DL19VR6	1.0000 % DB 1 11/19/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	96.40%	2'245'799.30	0.70	a)
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	2'500	0	500	2'000 EUR	103.02%	1'920'014.78	0.60	a)
ES0344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	0	1'500	0	1'500 EUR	101.18%	1'414'292.36	0.44	a)
FI4000282629	2.7500 % METSA 2 3/4 09/29/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012199123	3.8750 % SCOR 3 7/8 PERP	500	0	0	500 EUR	98.37%	458'301.19	0.14	a)
FR0013398229	3.2500 % ENGIFP 3 1/4 PERP	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013413887	2.3750 % ORAFP 2 3/8 PERP EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013445335	1.6250 % VIEFP 1 5/8 PERP	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013476611	1.1250 % BNP 1 1/8 01/15/32 EMTN	1'500	500	0	2'000 EUR	91.17%	1'699'113.28	0.53	a)
FR0013478252	1.5000 % AKEFP 1 1/2 PERP	0	1'500	0	1'500 EUR	93.77%	1'310'634.71	0.41	a)
FR0013508512	1.0000 % ACAFP 1 04/22/26 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	96.65%	2'251'460.21	0.70	a)
FR00140005L7	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	89.11%	2'075'785.47	0.65	a)
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	0	2'500	0	2'500 EUR	88.38%	2'058'826.02	0.64	a)
FR0014002S57	0.0100 % BFCM 0.01 05/11/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	92.95%	1'732'230.80	0.54	a)
FR0014005EJ6	1.0000 % BNFP 1 PERP	1'500	0	0	1'500 EUR	91.79%	1'283'029.01	0.40	a)
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	91.31%	850'898.49	0.26	a)
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	2'400	0	0	2'400 EUR	105.31%	2'355'119.73	0.73	a)
FR001400FOH3	5.0000 % DECFP 5 01/11/29	0	1'500	0	1'500 EUR	106.10%	1'483'075.98	0.46	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.
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	102.23%	952'617.92	0.30	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFPP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	105.92%	1'973'912.29	0.61	a)
XS1048428442	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1069539291	2.3750 % DGELN 2 3/8 05/20/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	98.11%	914'216.87	0.28	a)
XS1072516690	3.0000 % PLD 3 06/02/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1076781589	4.3750 % NNGRNV 4 3/8 PERP EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1109836038	3.3750 % HANRUE 3 3/8 PERP	1'500	0	0	1'500 EUR	98.29%	1'373'813.32	0.43	a)
XS1115800655	5.0000 % ASRND 5 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1155697243	5.0500 % LAMON 5.05 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1180651587	4.2500 % ACHMEA 4 1/4 PERP EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1189263400	1.1250 % NDAFH 1 1/8 02/12/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	1'500	500	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1197775692	1.5000 % APTV 1 1/2 03/10/25	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1197833053	1.1250 % KO 1 1/8 03/09/27	1'000	0	0	1'000 EUR	94.71%	882'553.02	0.27	a)
XS1245292807	4.3750 % SLHNXV 4 3/8 PERP	2'500	0	0	2'500 EUR	99.38%	2'315'221.22	0.72	a)
XS1372839214	2.2000 % VOD 2.2 08/25/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550951138	2.3180 % TELEFO 2.318 10/17/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.39%	898'235.85	0.28	a)
XS1602130947	3.3750 % LEVI 3 3/8 03/15/27	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1602547264	1.7760 % BAC 1.776 05/04/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	96.28%	1'345'760.34	0.42	a)
XS1678970291	2.0000 % BACR 2 02/07/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1718393439	0.8750 % NTGYSM 0 7/8 05/15/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	1'500	0	0	1'500 EUR	96.44%	1'348'024.70	0.42	a)
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1891174341	2.5000 % DLR 2 1/2 01/16/26	1'000	0	0	1'000 EUR	97.41%	907'721.96	0.28	a)
XS1951220596	3.7500 % CABKSM 3 3/4 02/15/29 EMTN	800	0	0	800 EUR	99.98%	745'313.80	0.23	a)
XS1960678255	1.1250 % MDT 1 1/8 03/07/27	1'500	0	0	1'500 EUR	94.51%	1'320'992.09	0.41	a)
XS1974787480	1.7500 % TTEFP 1 3/4 PERP EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2000719992	3.5000 % ENELIM 3 1/2 PERP	200	0	0	200 EUR	98.40%	183'383.84	0.06	a)
XS2010039035	0.9500 % DBHNGR 0.95 PERP	400	0	0	400 EUR	96.09%	358'146.32	0.11	a)
XS2011260531	1.6250 % MRKGR 1 5/8 06/25/2079	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2021467753	0.9000 % STANLN 0.9 07/02/27 EMTN	800	0	0	800 EUR	93.79%	699'146.82	0.22	a)
XS2027364327	1.6250 % LOGICR 1 5/8 07/15/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	91.59%	1'280'233.50	0.40	a)
XS2027957815	1.1250 % BACRED 1 1/8 07/15/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2035564975	1.1250 % ENBW 1 1/8 11/05/2079	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2053052895	0.3750 % EDPLP 0 3/8 09/16/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	93.11%	1'301'423.49	0.40	a)
XS2063232727	0.5000 % C 0 1/2 10/08/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	92.56%	862'527.82	0.27	a)
XS2069407786	1.6250 % CPIPGR 1 5/8 04/23/27 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082969655	1.0000 % BKIR 1 11/25/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2104915033	0.1900 % NGGLN 0.19 01/20/25	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2115094737	0.3750 % SEB 0 3/8 02/11/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	91.42%	851'895.55	0.26	a)
XS2126058168	0.3910 % SANUK 0.391 02/28/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	99.74%	464'726.21	0.14	a)
XS2148623106	3.5000 % LLOYDS 3 1/2 04/01/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156607702	0.6250 % ENBW 0 5/8 04/17/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2176783319	1.2500 % ENIIM 1 1/4 05/18/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.80%	446'331.73	0.14	a)
XS2179037697	2.1250 % ISPIM 2 1/8 05/26/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	0	1'000	0	1'000 EUR	97.06%	904'395.30	0.28	a)
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	96.83%	1'804'671.88	0.56	a)
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2199266003	0.7500 % BAYNGR 0 3/4 01/06/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'500	1'000	0	2'500 EUR	93.41%	2'176'097.82	0.68	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	400	0	0	400 EUR	94.75%	353'166.58	0.11	a)
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	1'000	0	0	1'000 EUR	94.89%	884'258.29	0.27	a)
XS2289133915	0.3250 % UCGIM 0.325 01/19/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	0	3'500	0	3'500 EUR	90.21%	2'942'138.49	0.91	a)
XS2295335413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	0	1'500	0	1'500 EUR	91.93%	1'284'915.98	0.40	a)
XS2331216577	0.1250 % SCBNOR 0 1/8 04/14/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	0	1'000	0	1'000 EUR	91.92%	856'545.43	0.27	a)
XS2338643740	0.4060 % MS 0.406 10/29/27	1'000	0	0	1'000 EUR	92.15%	858'651.38	0.27	a)
XS2345996743	1.0000 % ERICB 1 05/26/29 EMTN	1'000	0	1'000	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.
XS2346206902	0.4500 % AMT 0.45 01/15/27	500	0	0	500 EUR	91.58%	426'688.59	0.13	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	89.56%	2'503'718.06	0.78	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	85.15%	1'586'882.72	0.49	a)
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	1'100	900	0	2'000 EUR	87.23%	1'625'591.27	0.51	a)
XS2374595044	0.1250 % VW 0 1/8 02/12/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	200	800	0	1'000 EUR	86.35%	804'642.05	0.25	a)
XS2388876232	0.9660 % MBKPW 0.966 09/21/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404027935	0.2500 % SWEDA 0 1/4 11/02/26 GMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404629235	0.1250 % SHBASS 0 1/8 11/03/26 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2412267358	1.0000 % ATIM 1 11/25/26 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2416413339	0.3750 % RABOBK 0 3/8 12/01/27 GMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2431318711	0.6250 % LOGICR 0 5/8 11/17/25 EMTN	600	0	0	600 EUR	93.42%	522'297.02	0.16	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	92.75%	864'307.64	0.27	a)
XS2436807866	0.8750 % PTHREE 0 7/8 01/26/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.26%	347'597.91	0.11	a)
XS2438026440	0.8750 % THAMES 0 7/8 01/31/28	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2455392584	2.6250 % SABSMM 2 5/8 03/24/26 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2465792294	2.2500 % CLNXSM 2 1/4 04/12/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	97.27%	1'359'556.20	0.42	a)
XS2466172363	1.6250 % DTRGR 1 5/8 04/06/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2477935345	1.6250 % TENN 1 5/8 11/17/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2479941499	1.5000 % V 1 1/2 06/15/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2483607474	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/23/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2485162163	2.2500 % EVKGR 2 1/4 09/25/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2488626610	3.1000 % DUK 3.1 06/15/28	500	0	0	500 EUR	98.79%	460'281.35	0.14	a)
XS2494945939	3.8750 % RTOLN 3 7/8 06/27/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2496288593	3.0000 % UNIMUS 3 06/30/27 EMTN	850	0	850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	99.11%	3'694'215.56	1.15	a)
XS2527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	700	800	500	1'000 EUR	99.34%	925'706.44	0.29	a)
XS2528858033	4.0670 % NWVG 4.067 09/06/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	101.67%	1'326'294.24	0.41	a)
XS2530756191	3.0000 % WKLNA 3 09/23/26	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2555420103	5.8500 % UCGIM 5.85 11/15/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	105.83%	1'479'190.21	0.46	a)
XS2558395278	4.0490 % ENBW 4.049 11/22/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	104.48%	1'460'432.31	0.45	a)
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	2'200	0	700	1'500 EUR	101.85%	1'423'643.35	0.44	a)
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2573331324	3.6250 % ABNAV 3 5/8 01/10/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	106.11%	988'763.91	0.31	a)
XS2582404724	5.7500 % ZFFNGR 5 3/4 08/03/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	102.69%	1'148'307.61	0.36	a)
XS2592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	103.77%	1'740'475.70	0.54	a)
XS2598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	102.53%	1'050'965.02	0.33	a)
XS2626022573	4.1250 % WPLPN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	104.70%	975'606.36	0.30	a)
XS2643041721	4.1250 % SEB 4 1/8 06/29/27 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	105.27%	1'471'376.75	0.46	a)
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	0	500	0	500 EUR	100.79%	469'604.38	0.15	a)
XS2715940891	4.2200 % SDZSW 4.22 04/17/30	0	2'400	0	2'400 EUR	104.40%	2'334'902.57	0.73	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	102.66%	2'008'951.26	0.62	a)
XS2745725155	3.8750 % VW 3 7/8 10/11/28 EMTN	0	1'300	0	1'300 EUR	101.50%	1'229'535.92	0.38	a)
XS2750308483	4.7500 % ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN	0	1'400	0	1'400 EUR	100.82%	1'315'270.73	0.41	a)
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	101.06%	1'130'036.13	0.35	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	1'500	0	1'500 EUR	101.94%	1'424'873.38	0.44	a)
EUR							104'377'431.96	32.44	
XS0138717441	6.1250 % AVLN 6 1/8 11/14/36	0	1'000	0	1'000 GBP	101.66%	1'110'585.25	0.35	a)
XS1134541561	5.4530 % AXASA 5.453 PERP EMTN	200	800	0	1'000 GBP	99.75%	1'089'698.01	0.34	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	94.74%	1'034'945.46	0.32	a)
XS1699636574	2.2500 % LLOYDS 2 1/4 10/16/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1716248197	2.2560 % HSBC 2.256 11/13/26 DIP	2'000	0	0	2'000 GBP	94.96%	2'074'653.91	0.64	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2172960481	3.6220 % NWVG 3.622 08/14/30	700	0	0	700 GBP	96.27%	736'138.80	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.
X52195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	200	0	0	200 GBP	94.98%	207'524.38	0.06	a)
X52528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 GBP	103.62%	1'584'703.84	0.49	a)
X52711945878	7.0900 % BACR 7.09 11/06/29	0	1'300	0	1'300 GBP	106.29%	1'509'457.33	0.47	a)
X52729188644	5.3750 % PACLIF 5 3/8 11/30/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	102.67%	1'121'564.16	0.35	a)
GBP							10'469'271.14	3.25	
BE6254003252	5.5000 % BARY 5 1/2 06/15/23 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	500	1'000	0	1'500 USD	91.92%	1'182'839.51	0.37	a)
IL0060001943	5.0000 % ISRELE 5 11/12/24 6	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00084EAE86	6.3390 % ABNANV 6.339 09/18/27 REGS	0	2'500	0	2'500 USD	102.31%	2'194'165.84	0.68	a)
US00206RDQ20	4.2500 % T 4 1/4 03/01/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RML32	1.7000 % T 1.7 03/25/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RMP46	5.5390 % T 5.539 02/20/26	0	3'000	0	3'000 USD	100.05%	2'574'954.15	0.80	a)
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	1'800	0	0	1'800 USD	98.34%	1'518'571.08	0.47	a)
US00774MAU99	1.6500 % AER 1.65 10/29/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	500	700	0	1'200 USD	92.75%	954'794.32	0.30	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	0	400	0	400 USD	102.19%	350'652.82	0.11	a)
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBH58	2.3500 % MO 2.35 05/06/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.70%	829'573.68	0.26	a)
US023135BX34	1.0000 % AMZN 1 05/12/26	2'500	0	1'000	1'500 USD	92.57%	1'191'160.64	0.37	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	2'500	0	0	2'500 USD	98.54%	2'113'331.77	0.66	a)
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	550	0	0	550 USD	104.24%	491'812.34	0.15	a)
US02665WDZ14	1.3000 % HNDA 1.3 09/09/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	92.16%	790'571.91	0.25	a)
US029163AD49	7.4500 % MUNRE 7.45 12/15/26 B	1'000	0	0	1'000 USD	107.60%	923'046.30	0.29	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	0	1'000	0	1'000 USD	81.93%	702'852.23	0.22	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	0	1'000	0	1'000 USD	87.73%	752'592.87	0.23	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.98%	797'591.03	0.25	a)
US031162BV19	3.6250 % AMGN 3 5/8 05/22/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03522AAG58	3.6500 % ABIBB 3.65 02/01/26	500	0	0	500 USD	98.17%	421'066.02	0.13	a)
US037833EB24	0.7000 % AAPL 0.7 02/08/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US046353AV09	0.7000 % AZN 0.7 04/08/26	400	0	0	400 USD	92.23%	316'462.85	0.10	a)
US052528AL09	2.9500 % ANZ 2.95 07/22/30 144A	400	0	0	400 USD	95.77%	328'625.10	0.10	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	96.76%	1'660'075.89	0.52	a)
US05565AAR41	4.3750 % BNP 4 3/8 05/12/26 144A	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	400	1'100	0	1'500 USD	98.23%	1'263'986.21	0.39	a)
US05578AAP30	1.0000 % BPCEGP 1 01/20/26 144A	1'500	0	0	1'500 USD	92.46%	1'189'698.38	0.37	a)
US05578BAV80	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/14/25 REGS	300	0	0	300 USD	96.77%	249'029.57	0.08	a)
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	3'000	0	600	2'400 USD	100.57%	2'070'650.86	0.64	a)
US05964HAL96	1.8490 % SANTAN 1.849 03/25/26	1'000	0	0	1'000 USD	93.17%	799'284.99	0.25	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	1'600	0	0	1'600 USD	99.58%	1'366'794.90	0.42	a)
US05971KAA79	5.1790 % SANTAN 5.179 11/19/25	400	0	0	400 USD	99.40%	341'080.49	0.11	a)
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	4'200	0	700	3'500 USD	96.60%	2'900'523.74	0.90	a)
US06051GKW86	4.9480 % BAC 4.948 07/22/28 MTN	0	1'000	0	1'000 USD	100.13%	858'962.87	0.27	a)
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	96.20%	825'210.59	0.26	a)
US06407FZE11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	300	0	0	300 USD	92.68%	238'511.47	0.07	a)
US064159VJ25	4.9000 % BNS 4.9 PERP	400	800	0	1'200 USD	96.30%	991'331.46	0.31	a)
US09062XAF06	4.0500 % BIIB 4.05 09/15/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659W2N34	1.3230 % BNP 1.323 01/13/27 144A	2'000	0	500	1'500 USD	92.66%	1'192'267.47	0.37	a)
US110122DN59	0.7500 % BMY 0 3/4 11/13/25	1'200	0	0	1'200 USD	93.48%	962'292.11	0.30	a)
US11135FBB67	3.1500 % AVGO 3.15 11/15/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US120568BB55	1.6300 % BG 1.63 08/17/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US125523AG54	4.1250 % CI 4 1/8 11/15/25	500	0	0	500 USD	98.49%	422'443.29	0.13	a)
US126650CU24	2.8750 % CVS 2 7/8 06/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	95.61%	820'202.81	0.25	a)
US14913R2H93	0.8000 % CAT 0.8 11/13/25 MTN	2'000	0	0	2'000 USD	93.61%	1'606'040.42	0.50	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	0	2'000	0	2'000 USD	89.18%	1'529'976.09	0.48	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	750	0	750 USD	102.14%	657'164.44	0.20	a)
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.20%	825'271.86	0.26	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	3'500	0	0	3'500 USD	91.85%	2'757'785.81	0.86	a)
US19123MAF05	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	91.05%	781'056.75	0.24	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	0	1'000	0	1'000 USD	103.96%	891'855.68	0.28	a)
US20030NBW02	2.3500 % CMCSA 2.35 01/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	94.15%	1'615'283.01	0.50	a)
US2027A0HR32	4.5000 % CBAAU 4 1/2 12/09/25 144A	400	0	0	400 USD	98.66%	338'536.85	0.11	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.
US21684AAF30	3.7500 % RABOBK 3 3/4 07/21/26 BKNT	300	0	0	300 USD	96.30%	247'827.07	0.08	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	0	1'700	0	1'700 USD	103.50%	1'509'426.86	0.47	a)
US224044CE55	3.8500 % COXENT 3.85 02/01/25 144A	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US225401AF50	3.8690 % UBS 3.869 01/12/29 144A	0	2'000	0	2'000 USD	94.94%	1'628'871.41	0.51	a)
US22822VAC54	3.7000 % CCI 3.7 06/15/26	400	0	0	400 USD	96.84%	332'293.41	0.10	a)
US22822VBA89	5.0000 % CCI 5 01/11/28	700	800	0	1'500 USD	99.60%	1'281'609.36	0.40	a)
US23291KAG04	2.2000 % DHR 2.2 11/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US23329PAF71	1.1270 % DNBNO 1.127 09/16/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	93.21%	799'632.16	0.25	a)
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	93.51%	802'192.50	0.25	a)
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	200	0	0	200 USD	92.35%	158'439.52	0.05	a)
US24422EVK27	0.7000 % DE 0.7 01/15/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	93.04%	798'175.29	0.25	a)
US24422EWA36	1.7000 % DE 1.7 01/11/27 MTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	0	2'000	500	1'500 USD	100.66%	1'295'213.56	0.40	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703TAD81	6.0200 % DELL 6.02 06/15/26	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	0	3'000	0	3'000 USD	102.43%	2'636'212.52	0.82	a)
US251526CB33	3.9610 % DB 3.961 11/26/25	500	0	0	500 USD	98.42%	422'156.56	0.13	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	1'500	0	0	1'500 USD	94.68%	1'218'315.11	0.38	a)
US25470DAL38	4.9000 % WBD 4.9 03/11/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26138EAS81	3.4000 % KDP 3.4 11/15/25	2'500	0	0	2'500 USD	97.41%	2'088'981.80	0.65	a)
US278642AX15	1.4000 % EBAY 1.4 05/10/26	300	0	0	300 USD	92.66%	238'471.05	0.07	a)
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBH70	1.6000 % ENBCN 1.6 10/04/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.15%	790'484.70	0.25	a)
US29250NBX21	6.0000 % ENBCN 6 11/15/28	0	2'000	0	2'000 USD	104.90%	1'799'736.86	0.56	a)
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	0	1'000	0	1'000 USD	94.33%	809'175.04	0.25	a)
US29444UBK16	1.0000 % EQIX 1 09/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	93.68%	803'649.49	0.25	a)
US29446MAJ18	1.7500 % EQNR 1 3/4 01/22/26	3'200	0	0	3'200 USD	94.73%	2'600'493.22	0.81	a)
US30231GAT94	3.0430 % XOM 3.043 03/01/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31429KAD54	2.0500 % CCDJ 2.05 02/10/25 144A	400	0	0	400 USD	96.92%	332'554.47	0.10	a)
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	0	400	0	400 USD	100.90%	346'211.10	0.11	a)
US31620MBR60	1.1500 % FIS 1.15 03/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.98%	797'647.52	0.25	a)
US337738AS78	2.7500 % FI 2 3/4 07/01/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US341081FZ53	2.8500 % NEE 2.85 04/01/25	1'300	0	300	1'000 USD	97.81%	839'065.15	0.26	a)
US345397B850	2.3000 % F 2.3 02/10/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345397D260	6.9500 % F 6.95 06/10/26	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	0	1'000	0	1'000 USD	104.41%	895'688.32	0.28	a)
US35671DCE31	4.1250 % FCX 4 1/8 03/01/28	2'000	0	0	2'000 USD	96.10%	1'648'811.81	0.51	a)
US37045XCX21	2.7500 % GM 2 3/4 06/20/25	2'500	0	0	2'500 USD	96.82%	2'076'503.67	0.65	a)
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US375558BF95	3.6500 % GILD 3.65 03/01/26	300	0	0	300 USD	97.77%	251'612.23	0.08	a)
US377372AM97	3.6250 % GSK 3 5/8 05/15/25	1'200	0	0	1'200 USD	98.58%	1'014'762.82	0.32	a)
US38141GXM13	1.0930 % GS 1.093 12/09/26 VAR	4'000	0	0	4'000 USD	92.85%	3'185'899.22	0.99	a)
US40049JAV98	6.6250 % TELVIS 6 5/8 03/18/25	1'000	0	0	1'000 USD	101.28%	868'830.48	0.27	a)
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	0	1'000	0	1'000 USD	97.21%	833'956.06	0.26	a)
US437076BM30	3.0000 % HD 3 04/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	97.05%	832'568.61	0.26	a)
US44891C8Y84	1.0000 % HYNMTR 1 09/17/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCB72	5.5000 % HYNMTR 5 1/2 03/30/26 REGS	0	650	0	650 USD	100.65%	561'221.34	0.17	a)
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	102.84%	882'212.94	0.27	a)
US458140BP43	3.4000 % INTC 3.4 03/25/25	800	0	0	800 USD	98.40%	675'318.31	0.21	a)
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459506AN18	1.2300 % IFF 1.23 10/01/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PAR73	4.0050 % JPM 4.005 04/23/29	0	5'000	0	5'000 USD	96.65%	4'145'418.67	1.29	a)
US46647PCB04	1.5780 % JPM 1.578 04/22/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47216QAB95	1.3750 % JDEPNA 1 3/8 01/15/27 144A	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US478160BY94	2.4500 % JNJ 2.45 03/01/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	0	1'000	0	1'000 USD	83.03%	712'268.16	0.22	a)
US49177JAB89	5.5000 % KVUE 5 1/2 03/22/25	0	2'000	0	2'000 USD	100.79%	1'729'195.35	0.54	a)
US496902AN77	5.9500 % KCN 5.95 03/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	97.75%	1'677'065.68	0.52	a)
US539439AQ24	3.5740 % LLOYDS 3.574 11/07/28	0	1'500	0	1'500 USD	94.16%	1'211'631.46	0.38	a)
US55608JAR95	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 144A	2'000	0	0	2'000 USD	92.34%	1'584'341.36	0.49	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.
US55903VAC72	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24 144A	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAG86	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAW37	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VBA08	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27	0	1'000	0	1'000 USD	96.05%	823'975.64	0.26	a)
US559222AR55	4.1500 % MGCN 4.15 10/01/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US56501RAC07	4.1500 % MFCCN 4.15 03/04/26	1'000	0	0	1'000 USD	98.43%	844'386.95	0.26	a)
US571676AA35	2.7000 % MARS 2.7 04/01/25 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629WDE75	1.2000 % MASSMU 1.2 07/16/26 144A	2'500	0	0	2'500 USD	91.54%	1'963'254.90	0.61	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	101.40%	869'825.59	0.27	a)
US577081BD37	5.8750 % MAT 5 7/8 12/15/27 144A	0	1'500	0	1'500 USD	100.31%	1'290'764.30	0.40	a)
US58013MEY66	3.7000 % MCD 3.7 01/30/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	98.37%	843'896.55	0.26	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GBY44	3.4500 % MET 3.45 12/18/26 144A	2'500	0	0	2'500 USD	96.59%	2'071'440.94	0.64	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BM49	4.9750 % MU 4.975 02/06/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BP79	4.1850 % MU 4.185 02/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	97.96%	840'317.44	0.26	a)
US606822BW35	0.9530 % MUFU 0.953 07/19/25	1'500	0	0	1'500 USD	97.82%	1'258'710.44	0.39	a)
US60687YAD13	3.4770 % MIZUHO 3.477 04/12/26 144A	800	0	0	800 USD	96.78%	664'152.81	0.21	a)
US60920LAF13	2.2500 % MDLZ 2 1/4 09/19/24 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174467X10	5.0000 % MS 5 11/24/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61772BAB99	1.5930 % MS 1.593 05/04/27	3'500	0	0	3'500 USD	92.58%	2'779'735.25	0.86	a)
US628530BK28	4.5500 % VTRS 4.55 04/15/28	0	2'000	0	2'000 USD	97.60%	1'674'439.42	0.52	a)
US62854AAN46	3.9500 % VTRS 3.95 06/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	97.11%	833'048.69	0.26	a)
US62954HBE71	4.4000 % NXPI 4.4 06/01/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954WAC91	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	92.62%	794'555.41	0.25	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	150	0	150 USD	102.48%	131'871.09	0.04	a)
US6325C0EB33	1.8870 % NAB 1.887 01/12/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	92.46%	793'179.63	0.25	a)
US63859UBH59	1.5000 % NWIDE 1 1/2 10/13/26 144A	500	0	0	500 USD	91.18%	391'101.36	0.12	a)
US641062AE42	3.5000 % NESNVX 3 1/2 09/24/25 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.36%	843'797.91	0.26	a)
US64952WDDW01	0.8500 % NYLIFE 0.85 01/15/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	92.88%	2'390'333.91	0.74	a)
US65339KBP49	6.0510 % NEE 6.051 03/01/25	0	1'600	0	1'600 USD	100.84%	1'384'024.21	0.43	a)
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	93.88%	1'610'721.22	0.50	a)
US67066GAE44	3.2000 % NVDA 3.2 09/16/26	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	2'000	0	2'000 USD	100.46%	1'723'572.20	0.54	a)
US674599DC69	5.5500 % OXY 5.55 03/15/26	700	0	0	700 USD	100.73%	604'879.09	0.19	a)
US68389XCC74	1.6500 % ORCL 1.65 03/25/26	1'000	1'000	0	2'000 USD	93.47%	1'603'608.26	0.50	a)
US6944PL2E89	1.3750 % PACLIF 1 3/8 04/14/26 144A	500	0	0	500 USD	92.79%	398'003.87	0.12	a)
US713448EQ79	2.2500 % PEP 2 1/4 03/19/25	1'500	0	0	1'500 USD	97.23%	1'251'144.40	0.39	a)
US714264AM01	3.2500 % RIFP 3 1/4 06/08/26 144A	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US717081DV27	2.7500 % PFE 2 3/4 06/03/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.01%	823'628.78	0.26	a)
US74256LAU35	3.0000 % PFG 3 04/18/26 144A	400	0	0	400 USD	95.57%	327'948.81	0.10	a)
US742718FV65	1.9000 % PG 1.9 02/01/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744320AM42	5.6250 % PRU 5 5/8 06/15/43	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US745867AX94	5.0000 % PHM 5 01/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	100.64%	863'323.62	0.27	a)
US75625QAD16	2.7500 % RKTLN 2 3/4 06/26/24 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US771196BV36	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 144A	2'000	0	0	2'000 USD	94.07%	1'613'895.96	0.50	a)
US780097BK63	4.2690 % NWG 4.269 03/22/25	500	0	0	500 USD	99.79%	428'028.55	0.13	a)
US78016EZM29	0.8750 % RY 0 7/8 01/20/26 GMTN	200	1'300	0	1'500 USD	92.95%	1'196'041.82	0.37	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	0	4'000	0	4'000 USD	83.86%	2'877'650.45	0.89	a)
US785592AJ58	5.7500 % SPLLLC 5 3/4 05/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BY05	2.4500 % SCHW 2.45 03/03/27	1'000	0	0	1'000 USD	93.38%	801'059.21	0.25	a)
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	0	2'000	0	2'000 USD	87.55%	1'502'079.94	0.47	a)
US822582BD31	3.2500 % RDSALN 3 1/4 05/11/25	800	0	0	800 USD	98.24%	674'225.12	0.21	a)
US82481LAD10	3.2000 % TACHEM 3.2 09/23/26	2'500	0	500	2'000 USD	96.23%	1'651'019.19	0.51	a)
US82655AAC71	4.1250 % SIGMA 4 1/8 05/02/26 144A	400	0	0	400 USD	97.12%	333'254.14	0.10	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	2'000	0	500	1'500 USD	96.61%	1'243'101.86	0.39	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'200	0	700	1'500 USD	103.35%	1'329'830.49	0.41	a)
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	0	2'200	0	2'200 USD	99.99%	1'887'005.78	0.59	a)
US855244BE89	4.7500 % SBUX 4 3/4 02/15/26	0	2'000	0	2'000 USD	100.26%	1'720'209.85	0.53	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.
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	2'500	0	2'500 USD	101.01%	2'166'192.89	0.67	a)
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	1'500	0	0	1'500 USD	95.03%	1'222'866.62	0.38	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	0	750	0	750 USD	103.28%	664'473.67	0.21	a)
US86563VAU35	0.8500 % SUMITR 0.85 03/25/24 144A	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	1'500	0	0	1'500 USD	96.97%	1'247'777.29	0.39	a)
US87264ABR59	2.2500 % TMUS 2 1/4 02/15/26	300	0	0	300 USD	94.89%	244'212.45	0.08	a)
US87264ADA07	4.8000 % TMUS 4.8 07/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	100.24%	859'878.71	0.27	a)
US87938WAT09	4.1030 % TELEFO 4.103 03/08/27	1'500	0	0	1'500 USD	97.84%	1'258'957.03	0.39	a)
US87969NAD75	3.1250 % TLAU 3 1/8 04/07/25 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US883556CS94	1.2150 % TMO 1.215 10/18/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89236TJK25	1.1250 % TOYOTA 1 1/8 06/18/26 MTN	2'000	0	0	2'000 USD	92.55%	1'587'843.89	0.49	a)
US904764AY33	2.9000 % UNANA 2.9 05/05/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.45%	818'838.28	0.25	a)
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEC23	1.1500 % UNH 1.15 05/15/26	1'500	0	0	1'500 USD	92.79%	1'194'051.12	0.37	a)
US92343VGG32	1.4500 % VZ 1.45 03/20/26	2'000	0	0	2'000 USD	93.27%	1'600'173.96	0.50	a)
US928563AD71	4.5000 % VMW 4 1/2 05/15/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US928563AJ42	1.4000 % VMW 1.4 08/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	91.50%	1'569'810.32	0.49	a)
US95000U3G61	6.3030 % WFC 6.303 10/23/29	0	1'000	0	1'000 USD	105.40%	904'181.25	0.28	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US958102AQ89	2.8500 % WDC 2.85 02/01/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214CX95	2.8500 % WSTP 2.85 05/13/26	500	0	0	500 USD	96.23%	412'775.06	0.13	a)
US961214EM13	2.8940 % WSTP 2.894 02/04/30	400	1'100	0	1'500 USD	96.96%	1'247'624.54	0.39	a)
US96950FAQ72	3.9000 % WMB 3.9 01/15/25	1'500	0	0	1'500 USD	98.79%	1'271'168.76	0.40	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	0	1'500	0	1'500 USD	102.97%	1'324'929.22	0.41	a)
US98978VAU70	5.4000 % ZTS 5.4 11/14/25	1'000	0	0	1'000 USD	100.95%	865'972.99	0.27	a)
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	103.21%	885'395.56	0.28	a)
USG0446NAM68	3.6250 % AALLN 3 5/8 09/11/24 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	96.35%	826'512.74	0.26	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	100.57%	862'748.32	0.27	a)
USG91139AC27	0.7500 % TAISEM 0 3/4 09/28/25 REGS	400	0	0	400 USD	93.40%	320'509.19	0.10	a)
USG91139AK43	4.3750 % TAISEM 4 3/8 07/22/27 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAJ36	4.2390 % NTT 4.239 07/25/25 REGS	500	0	0	500 USD	98.90%	424'185.38	0.13	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	0	400	0	400 USD	102.22%	350'740.55	0.11	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.29%	851'724.95	0.26	a)
USU09513HX08	3.9000 % BMW 3.9 04/09/25 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU4912XAA10	5.5000 % KVUE 5 1/2 03/22/25 REGS	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU5876JAE56	4.9500 % MBGGR 4.95 03/30/25 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU7000RAG75	5.1500 % NSCCLF 5.15 05/30/25 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU74079AT84	3.6250 % NFLX 3 5/8 06/15/25 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	98.26%	1'685'846.82	0.52	a)
USY3815N8G52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	0	600	0	600 USD	100.05%	514'966.23	0.16	a)
USY4760JAC72	2.3750 % KIAMTR 2 3/8 02/14/25 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY52758AC63	3.2500 % LGCHM 3 1/4 10/15/24 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	98.47%	844'682.00	0.26	a)
USY8085FBA76	1.5000 % HYUELE 1 1/2 01/19/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	92.65%	2'384'390.09	0.74	a)
XS1385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	99.96%	1'715'063.61	0.53	a)
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	98.75%	1'694'245.60	0.53	a)
XS1586330604	4.4000 % ABNANV 4.4 03/27/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1796077946	4.7000 % INTNED 4.7 03/22/28 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2049422343	4.2500 % SRENVX 4 1/4 PERP	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2078692014	3.5160 % STANLN 3.516 02/12/30 EMTN	200	800	0	1'000 USD	96.48%	827'638.98	0.26	a)
XS2369276014	1.5000 % CONAMP 1 1/2 09/09/26	1'000	0	0	1'000 USD	91.33%	783'504.68	0.24	a)
XS2465969132	3.5000 % KORWAT 3 1/2 04/27/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2532384372	6.2530 % BKIR 6.253 09/16/26 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2532478190	6.3000 % EDPLP 6.3 10/11/27 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD							182'339'052.49	56.68	
Derivative Finanzinstrumente							701'214.42	0.22	
Futures							0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	-220	220	0	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.
03/23	US 5YR NOTE (CBT) MAR23	-160	160	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	220	220	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 5YR NOTE (CBT) JUN23	0	160	160	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	25	25	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	25	25	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall	24.02.2023	174'355'729	189'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	24.02.2023	9'949'320	14'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	24.02.2023	8'554'264	7'600'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	24.02.2023	103'850'136	104'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	24.02.2023	1'001'702	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	24.02.2023	1'387'040	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	24.02.2023	2'736'885	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	23.03.2023	177'429'120	192'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	23.03.2023	9'887'362	14'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	23.03.2023	103'548'795	105'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	23.03.2023	8'503'252	7'600'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	23.03.2023	931'280	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	23.03.2023	1'069'825	1'000'000	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.04.2023	178'640'028	193'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	20.04.2023	9'683'359	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.04.2023	102'449'671	103'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	20.04.2023	8'386'235	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	25.05.2023	9'567'100	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	25.05.2023	177'008'634	198'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	25.05.2023	104'087'336	106'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	25.05.2023	8'222'799	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	25.05.2023	2'000'000	1'960'258	EUR/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	22.06.2023	9'496'344	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	22.06.2023	101'816'820	105'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	22.06.2023	178'245'693	199'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	22.06.2023	8'244'029	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.07.2023	177'729'089	199'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	20.07.2023	8'461'774	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	20.07.2023	9'667'558	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.07.2023	101'775'648	104'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.07.2023	965'035	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	24.08.2023	9'256'933	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	24.08.2023	8'277'884	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	24.08.2023	103'107'447	107'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	24.08.2023	175'307'595	205'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	24.08.2023	2'564'187	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	06.09.2023	9'566'330	10'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	06.09.2023	5'282'862	6'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	21.09.2023	8'283'101	7'400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	21.09.2023	9'249'526	14'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	21.09.2023	101'429'598	106'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	21.09.2023	178'465'524	204'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	21.09.2023	10'000'000	9'557'930	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	21.09.2023	6'000'000	5'274'564	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	16.11.2023	174'791'428	196'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	16.11.2023	89'800'832	94'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	16.11.2023	8'284'980	7'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	16.11.2023	9'545'530	14'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	21.12.2023	90'494'458	94'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	21.12.2023	176'109'332	196'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	21.12.2023	8'387'132	7'600'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	21.12.2023	9'364'507	14'400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	21.12.2023	1'313'340	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	21.12.2023	2'361'035	2'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	18.01.2024	175'390'173	203'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	18.01.2024	95'543'273	101'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	18.01.2024	8'541'881	7'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	18.01.2024	9'426'636	14'600'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	18.01.2024	3'000'000	2'838'666	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	18.01.2024	3'000'000	2'585'901	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	18.01.2024	3'000'000	2'547'282	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	18.01.2024	2'000'000	1'859'464	EUR/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	22.02.2024	2'839'450	5'000'000	CHF/AUD		8'486.94	0.00	b)
USD/CHF	Verfall	22.02.2024	10'196'724	12'000'000	CHF/USD		-74'147.43	-0.02	b)
GBP/CHF	Verfall	22.02.2024	2'163'442	2'000'000	CHF/GBP		-16'713.26	-0.01	b)

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.
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		8'385'795	9'000'000		CHF/EUR	10'747.55	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 22.02.2024		1'269'602	2'000'000		CHF/CAD	-12'042.20	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		172'429'056	201'000'000		CHF/USD	390'343.75	0.12	b)
	GBP/CHF Verfall 22.02.2024		8'462'696	7'800'000		CHF/GBP	-39'934.69	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		90'726'331	97'000'000		CHF/EUR	461'588.45	0.14	b)
	CAD/CHF Verfall 22.02.2024		9'347'274	14'700'000		CHF/CAD	-72'826.14	-0.02	b)
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		5'614'788	6'000'000		CHF/EUR	31'399.05	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		1'865'278	2'000'000		CHF/EUR	4'154.60	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		1'721'992	2'000'000		CHF/USD	10'157.80	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							701'214.42	0.22	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	4'907'691.03	1.53
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	312'986'495.12	97.29
Derivative Finanzinstrumente	701'214.42	0.22
Sonstige Vermögenswerte	3'118'640.70	0.97
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	321'714'041.27	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-3'994.87	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	321'710'046.40	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	312'986'495.12	97.29
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	701'214.42	0.22
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

					Kurswert CHF	in % 7)	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte						29'162'595.29	9.06
CA89117FWS42	3.1050 % TD 3.105 04/22/30 MTN	500	CAD	97.42%	312'748.68	0.10	
ES0344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	1'000	EUR	101.18%	942'861.57	0.29	
US00084EAE86	6.3390 % ABNANV 6.339 09/18/27 REGS	2'000	USD	102.31%	1'755'332.67	0.55	
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	1'000	USD	92.75%	795'661.94	0.25	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	550	USD	104.24%	491'812.34	0.15	
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	1'000	USD	81.93%	702'852.23	0.22	
US05964HAL96	1.8490 % SANTAN 1.849 03/25/26	1'000	USD	93.17%	799'284.99	0.25	
US05971KAA79	5.1790 % SANTAN 5.179 11/19/25	200	USD	99.40%	170'540.25	0.05	
US06051GKW86	4.9480 % BAC 4.948 07/22/28 MTN	1'000	USD	100.13%	858'962.87	0.27	
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	750	USD	102.14%	657'164.44	0.20	
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'000	USD	96.20%	825'271.86	0.26	
US225401AF50	3.8690 % UBS 3.869 01/12/29 144A	2'000	USD	94.94%	1'628'871.41	0.51	
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	500	USD	94.33%	404'587.52	0.13	
US29446MAJ18	1.7500 % EQNR 1 3/4 01/22/26	2'500	USD	94.73%	2'031'635.33	0.63	
US377372AM97	3.6250 % GSK 3 5/8 05/15/25	500	USD	98.58%	422'817.85	0.13	
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	1'000	USD	97.21%	833'956.06	0.26	
US44891CCB72	5.5000 % HYNMTR 5 1/2 03/30/26 REGS	650	USD	100.65%	561'221.34	0.17	
US46647PAR73	4.0050 % JPM 4.005 04/23/29	1'600	USD	96.65%	1'326'533.97	0.41	
US55608JAR95	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 144A	600	USD	92.34%	475'302.40	0.15	
US61772BAB99	1.5930 % MS 1.593 05/04/27	1'000	USD	92.58%	794'210.07	0.25	
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	2'000	USD	93.88%	1'610'721.22	0.50	
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	800	USD	87.55%	600'831.98	0.19	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	1'500	USD	103.35%	1'329'830.49	0.41	
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	1'000	USD	99.99%	857'729.90	0.27	
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	750	USD	103.28%	664'473.67	0.21	
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	800	USD	103.21%	708'316.45	0.22	
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	1'000	USD	99.29%	851'724.95	0.26	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.01.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
XS1385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	2'000 USD	99.96%	1'715'063.61	0.53	
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	1'000 GBP	94.74%	1'034'945.46	0.32	
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	2'000 USD	98.75%	1'694'245.60	0.53	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	400 EUR	94.75%	353'166.58	0.11	
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	1'000 EUR	101.94%	949'915.59	0.30	

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
USD	1 = CHF	0.85785000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	20'209'063.95	64.910
Bond	CHF	8'018'192.78	25.754
Equity	CHF	1'236'493.98	3.972
Index bond	CHF	1'670'427.99	5.365
Total	CHF	31'134'178.70	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	314'931'211.34	97.893
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	-	-
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
AT CHF	CHF	-	-	-	-
DT 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	29'162'595.29
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	Max
AT CHF	0.800	1.200	0.600	0.200		4.000
DT CHF	0.390	0.700	0.290	0.100		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

ICE BofAML Global Corporate Bond Index 1 – 5 Jahre

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 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AT CHF	Ja	CHF	1.806	0.632	1.174
DT CHF	Ja	CHF	2.187	0.765	1.422
NT CHF	Ja	CHF	2.399	0.839	1.560

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

13 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.

Beim bestehenden Klassenkonzept für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR werden die nachfolgend aufgeführten und nie lancierten Anteilsklassen aus dem Klassenkonzept für dieses Teilvermögen gestrichen, vgl. § 6 Ziff. 4 und § 19 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages:

- AAH1 EUR
- BAH1 EUR
- CTH1 EUR
- DAH1 EUR
- GTH1 EUR

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

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

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

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

Zürich, 3. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

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