

# SWISSCANTO (CH) PENSION BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL HIGH YIELD

## Jahresbericht per 31.05.2023

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Pension Bond Fund  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DT CHF	3095586	CHF
GT CHF	19225188	CHF
NT CHF	19225187	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

Zürich, 28. September 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

### Swisscanto (CH) Pension Bond Fund, Zürich

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Domestic CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Foreign CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD
- ▶ Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Global High Yield

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Mai 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



#### 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 sowie dem Fondsvertrag 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. Mai 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	16
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	17
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
8	Pauschale Verwaltungskommission	18
9	Benchmark	18
10	TER	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	19
12	Fussnoten	19
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20
14	Pflichtpublikationen	22

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.06.2022	01.06.2021	01.06.2020	01.06.2019
	bis	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021	31.05.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		574'708'607.03	602'367'798.44	610'805'900.21	524'367'633.05
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'039'362.39	1'433'414.31	1'570'170.94	7'819'614.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'450.000	12'685.000	12'685.000	70'730.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.9854	113.0007	123.7800	110.5600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		109.9854	113.2606	123.7800	110.5600
Thesaurierung je Anteil		5.47	5.14	4.85	5.58
Total Expense Ratio (TER)		0.65 %	0.65 %	0.65 %	0.65 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			11'395'089.66	19'930'718.67	8'218'204.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode			113'775.000	181'790.000	83'982.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)			100.1546	109.6400	97.8600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP			100.3850	109.6400	97.8600
Thesaurierung je Anteil			4.66	4.40	5.04
Total Expense Ratio (TER)			0.55 %	0.55 %	0.55 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		573'669'244.64	589'539'294.47	589'305'010.60	508'329'814.69
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'649'990.925	5'673'939.205	5'200'498.101	5'044'246.671
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.5345	103.9030	113.3200	100.7700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		101.5345	104.1420	113.3200	100.7700
Thesaurierung je Anteil		5.69	5.43	5.14	5.76
Total Expense Ratio (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

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF	-1.02 %	-11.70 %	3.75 %	0.16 %
Klasse GT CHF (Schliessung 22.12.2022)	-3.42 %	-11.45 %	3.85 %	0.27 %
Klasse NT CHF	-0.37 %	-11.13 %	4.42 %	0.82 %

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)	31.05.2023	31.05.2022
Bankguthaben auf Sicht	25'145'997.61	21'380'894.78
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	542'862'534.26	575'072'478.32
Derivative Finanzinstrumente	-2'383'580.83	-2'639'639.42
Sonstige Vermögenswerte	9'084'266.89	8'560'347.09
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'709'217.93</b>	<b>602'374'080.77</b>
Andere Verbindlichkeiten	-610.90	-6'282.33
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'708'607.03</b>	<b>602'367'798.44</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'685.000	12'685.000
Zurückgenommene Anteile		-3'235.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'450.000</b>	<b>12'685.000</b>

Klasse GT CHF	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		113'775.000	181'790.000
Ausgegebene Anteile		-	45'669.000
Zurückgenommene Anteile		-113'775.000	-113'684.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>-</b>	<b>113'775.000</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'673'939.205	5'200'498.101
Ausgegebene Anteile		2'495.000	483'307.318
Zurückgenommene Anteile		-26'443.280	-9'866.214
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>5'649'990.925</b>	<b>5'673'939.205</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		602'367'798.44	610'805'900.21
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-10'809'407.76	-9'925'395.83
Saldo aus dem Anteilverkehr		-13'379'466.21	45'380'915.16
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-3'470'317.44	-43'893'621.10
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>574'708'607.03</b>	<b>602'367'798.44</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		121'039.56	16.48
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-9'618.66	-86'827.26
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		31'677'903.33	30'324'251.44
Erträge aus Wertpapierleihe		545'137.00	378'762.85
Sonstige Erträge		0.13	-0.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		8'370.85	1'103'665.99
<b>Total Ertrag</b>		<b>32'342'832.21</b>	<b>31'719'869.27</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-761.52	-6'117.03
Reglementarische Vergütungen		-13'064.97	-85'544.66
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-98'486.74	-177'093.12
<b>Total Aufwand</b>		<b>-112'313.23</b>	<b>-268'754.81</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>32'230'518.98</b>	<b>31'451'114.46</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-415'451.35	11'185'600.68
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		38'561.40	149'732.55
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>31'853'629.03</b>	<b>42'786'447.69</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-35'323'946.47	-86'680'068.79
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-3'470'317.44</b>	<b>-43'893'621.10</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.05.2023	31.05.2022
Nettoertrag	51'785.58	65'208.30
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>51'785.58</b>	<b>65'208.30</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	18'124.95	22'822.91
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	33'660.63	42'385.39
<b>Total</b>	<b>51'785.58</b>	<b>65'208.30</b>
<hr/>		
Klasse GT CHF	31.05.2023	31.05.2022
Nettoertrag	0.00	530'412.28
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>0.00</b>	<b>530'412.28</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	185'644.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	344'767.98
<b>Total</b>	<b>0.00</b>	<b>530'412.28</b>
<hr/>		
Klasse NT CHF	31.05.2023	31.05.2022
Nettoertrag	32'178'733.40	30'855'493.88
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>32'178'733.40</b>	<b>30'855'493.88</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	11'262'556.69	10'799'422.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	20'916'176.71	20'056'071.02
<b>Total</b>	<b>32'178'733.40</b>	<b>30'855'493.88</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>541'752'390.50</b>	<b>94.27</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>541'752'390.50</b>	<b>94.27</b>	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	0	1'250	0	1'250 CHF	94.25%	1'178'125.00	0.20	a)
XS2333565815	3.6250 % DUFNSW 3 5/8 04/15/26	4'500	350	0	4'850 CHF	95.17%	4'615'502.50	0.80	a)
<b>CHF</b>							<b>5'793'627.50</b>	<b>1.01</b>	
BE6342263157	5.7500 % AZELIS 5 3/4 03/15/28 REGS	0	1'450	0	1'450 EUR	101.10%	1'428'619.59	0.25	a)
FR0011765825	4.4980 % COFP 4.498 03/07/24 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012369122	3.5800 % COFP 3.58 02/07/25 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013533031	2.7500 % ORANOF 2 3/4 03/08/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534336	3.3750 % EDF 3 3/8 PERP	3'600	0	0	3'600 EUR	76.05%	2'668'292.75	0.46	a)
FR0014006G24	1.0000 % ATOFP 1 11/12/29	0	1'200	0	1'200 EUR	64.42%	753'360.96	0.13	a)
FR001400EFQ6	7.5000 % EDF 7 1/2 PERP EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	99.26%	2'901'968.20	0.50	a)
FR001400EJ15	5.3750 % ILDFP 5 3/8 06/14/27	0	4'900	1'000	3'900 EUR	99.02%	3'763'550.67	0.65	a)
FR001400FV85	5.6250 % ILDFP 5 5/8 02/15/30	0	3'500	0	3'500 EUR	96.27%	3'283'913.32	0.57	a)
NO0012826033	9.5510 % SKIBID FLOAT 03/02/28	0	3'750	0	3'750 EUR	96.39%	3'522'608.31	0.61	a)
PTEDPLOM0017	1.7000 % EDPL 1.7 07/20/2080	0	800	0	800 EUR	91.31%	711'875.31	0.12	a)
PTEDPROM0029	1.8750 % EDPL 1 7/8 08/02/2081	2'600	0	0	2'600 EUR	87.80%	2'224'781.86	0.39	a)
SE0016278352	6.7500 % HEIMST 6 3/4 PERP	0	1'000	0	1'000 EUR	46.38%	452'016.96	0.08	a)
XS0161100515	7.7500 % TITIM 7 3/4 01/24/33 EMTN	0	1'050	0	1'050 EUR	106.30%	1'087'800.98	0.19	a)
XS1057659838	3.7500 % PEMEX 3 3/4 04/16/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1317305198	1.8750 % CCL 1 7/8 11/07/22	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1468662801	3.5000 % ADNT 3 1/2 08/15/24 REGS	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1468662801XXX	3.5000 % *RETIRED*	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1496337236	4.1250 % CAR 4 1/8 11/15/24 REGS	1'000	0	0	1'000 EUR	99.03%	965'090.96	0.17	a)
XS1533933039	6.2500 % SCHUBR 6 1/4 12/15/23 REGS	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1551347393	2.2000 % TTMTIN 2.2 01/15/24 REGS	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1558491855	1.6250 % ATLM 1 5/8 02/03/25 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1568874983	3.7500 % PEMEX 3 3/4 02/21/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1577963058	4.5000 % NORICA 4 1/2 05/15/23	4'200	0	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1605600532	4.0000 % ATALIA 4 05/15/24 REGS	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1645722262	1.8750 % ATLM 1 7/8 07/13/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	87.59%	2'560'886.94	0.45	a)
XS1647815775	4.8750 % ADRBID 4 7/8 07/01/24 REGS	800	100	0	900 EUR	99.29%	870'923.76	0.15	a)
XS1685702794	5.2500 % INLOTG 5 1/4 09/15/24 REGS	4'000	0	0	4'000 EUR	94.71%	3'692'230.41	0.64	a)
XS1711584430	2.6250 % SPMIM 2 5/8 01/07/25 EMTN	1'000	0	200	800 EUR	96.25%	750'421.64	0.13	a)
XS1716927766	5.1050 % FERSM 5.105 PERP	3'500	0	1'500	2'000 EUR	97.30%	1'896'461.67	0.33	a)
XS1720690889	4.0000 % MATTER 4 11/15/27 REGS	1'450	0	0	1'450 EUR	92.41%	1'305'860.84	0.23	a)
XS1733958927	3.2500 % PROGST 3 1/4 12/15/24 REGS	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1756722069	6.7500 % KMEAGR 6 3/4 02/01/23 REGS	900	1	901	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1785467751	2.6250 % EOFP 2 5/8 06/15/25	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1789515134	3.8750 % BDC 3 7/8 03/15/28 REGS	1'200	0	0	1'200 EUR	93.47%	1'093'120.69	0.19	a)
XS1794209459	4.0000 % PAPREC 4 03/31/25 REGS	0	1'200	0	1'200 EUR	97.57%	1'141'116.49	0.20	a)
XS1795406658	3.8750 % TELEFO 3 7/8 PERP	1'300	0	0	1'300 EUR	92.54%	1'172'482.16	0.20	a)
XS1820759147	5.1250 % ATALIA 5 1/8 05/15/25 REGS	300	0	0	300 EUR	68.99%	201'698.72	0.04	a)
XS1824425182	3.6250 % PEMEX 3 5/8 11/24/25	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1827600724	4.0000 % CC 4 05/15/26	2'550	0	1'000	1'550 EUR	92.60%	1'398'850.75	0.24	a)
XS1841967356	7.0000 % TDCDC 7 06/17/23 REGS	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843461689	5.0000 % KOANO 5 07/15/25 REGS	1'750	0	0	1'750 EUR	95.25%	1'181'498.57	0.21	a)
XS1844997970	3.5000 % IGT 3 1/2 07/15/24 REGS	0	1'000	0	1'000 EUR	99.15%	360'845.45	0.06	a)
XS1844997970XXX	3.5000 % IGT 3 1/2 07/15/24 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1849464323	3.7500 % PTECLN 3 3/4 10/12/23	0	2'000	0	2'000 EUR	99.70%	733'320.63	0.13	a)
XS1849464323XX	3.7500 % PTECLN 3 3/4 10/12/23	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1849558900	6.2500 % LHMCFI 6 1/4 12/20/23 REGS	500	100	0	600 EUR	100.04%	141'166.76	0.02	a)
XS1851302312	4.7500 % BWY 4 3/4 04/15/24 REGS	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1881594946	6.7500 % ROSINI 6 3/4 10/30/25 REGS	2'200	0	1'000	1'200 EUR	100.76%	1'178'341.30	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X51888179477	3.1000 % VOD 3.1 01/03/2079	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51933828433	4.3750 % TELEFO 4 3/8 PERP	1'500	0	0	1'500 EUR	97.53%	1'425'679.30	0.25 a)	
X51959498160	3.0210 % F 3.021 03/06/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51963830002	3.1250 % EOFF 3 1/8 06/15/26	1'000	0	0	1'000 EUR	94.29%	918'964.39	0.16 a)	
X51990952779	4.7500 % LHMCFI 4 3/4 05/22/25 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52009038113	3.5000 % IGT 3 1/2 06/15/26 REGS	2'312	0	0	2'312 EUR	97.07%	2'187'082.24	0.38 a)	
X52010025836	7.2500 % STENA 7 1/4 02/15/28 REGS	0	2'600	0	2'600 EUR	101.40%	2'569'340.39	0.45 a)	
X52010030596	10.1250 % CCL 10 1/8 02/01/26 REGS	3'450	0	1'500	1'950 EUR	104.96%	1'994'717.21	0.35 a)	
X52010032618	2.6240 % SBBBSS 2.624 PERP	0	1'400	0	1'400 EUR	20.87%	284'682.68	0.05 a)	
X52010034077	3.3750 % KILOTO 3 3/8 12/15/26 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	90.83%	1'327'822.37	0.23 a)	
X52010039118	5.8750 % COFP 5 7/8 01/15/24 REGS	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52010039381	2.0000 % ZFFNGR 2 02/23/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52010039894	3.0000 % ZFFNGR 3 10/23/29	2'000	2'000	0	4'000 EUR	83.51%	3'255'621.45	0.57 a)	
X52010039977	2.5000 % ZFFNGR 2 1/2 10/23/27	1'000	0	0	1'000 EUR	87.01%	847'956.96	0.15 a)	
X52031871069	3.7500 % LOXAM 3 3/4 07/15/26	3'000	0	0	3'000 EUR	94.72%	2'769'260.52	0.48 a)	
X52034068432	3.7500 % TRIVIU 3 3/4 08/15/26 REGS	3'900	0	1'500	2'400 EUR	91.04%	2'129'287.30	0.37 a)	
X52036387525	2.1250 % ARGID 2 1/8 08/15/26 REGS	750	0	0	750 EUR	88.77%	648'839.40	0.11 a)	
X52051904733	2.3750 % IGT 2 3/8 04/15/28 REGS	2'700	0	0	2'700 EUR	90.03%	2'368'924.21	0.41 a)	
X52052290439	3.1250 % MATTER 3 1/8 09/15/26 REGS	1'550	0	0	1'550 EUR	92.02%	1'389'983.59	0.24 a)	
X52053846262	3.3750 % SFRFP 3 3/8 01/15/28 REGS	0	300	0	300 EUR	73.65%	215'326.18	0.04 a)	
X52054539627	2.5000 % SFRFP 2 1/2 01/15/25 REGS	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52056371334	2.8750 % TELEFO 2 7/8 PERP	4'300	0	0	4'300 EUR	85.67%	3'590'060.01	0.62 a)	
X52056730323	2.8750 % IFXGR 2 7/8 PERP EMTN	2'900	0	0	2'900 EUR	94.79%	2'679'071.53	0.47 a)	
X52059777594	7.2500 % LHMCFI 7 1/4 10/02/25 REGS	4'938	403	0	5'341 EUR	97.02%	5'049'871.46	0.88 a)	
X52065633203	6.2500 % EGBLFN 6 1/4 10/30/25 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52067263850	5.7500 % KANGRP 5 3/4 10/31/26 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	88.00%	1'286'378.62	0.22 a)	
X52074522975	2.6250 % EIRCOM 2 5/8 02/15/27	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52078976805	2.1250 % PPFTEL 2 1/8 01/31/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.26%	928'378.77	0.16 a)	
X52079413527	4.4960 % CITCON 4.496 PERP	0	500	0	500 EUR	64.51%	314'368.19	0.05 a)	
X52081474046	2.3750 % EOFF 2 3/8 06/15/27	2'000	0	0	2'000 EUR	87.93%	1'713'826.59	0.30 a)	
X52102489353	2.2500 % ALTICE 2 1/4 01/15/25 REGS	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52102493389	3.0000 % ALTICE 3 01/15/28 REGS	0	1'250	0	1'250 EUR	76.78%	935'359.16	0.16 a)	
X52110768525	3.7500 % STENA 3 3/4 02/01/25 REGS	3'000	0	1'700	1'300 EUR	96.08%	1'217'256.02	0.21 a)	
X52111946930	3.1250 % ADRBID 3 1/8 02/15/26 REGS	2'550	0	0	2'550 EUR	87.75%	2'180'755.01	0.38 a)	
X52111947748	3.6250 % ADRBID 3 5/8 02/15/28 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	78.53%	1'530'626.25	0.27 a)	
X52113253210	3.8750 % SAZKAG 3 7/8 02/15/27 REGS	3'500	0	0	3'500 EUR	93.32%	3'183'186.27	0.55 a)	
X52114146181	6.6250 % IMGPR 6 5/8 03/01/25 REGS	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52116386132	3.3750 % ZIGGO 3 3/8 02/28/30 REGS	2'650	0	0	2'650 EUR	71.91%	1'857'058.69	0.32 a)	
X52138128314	8.0000 % SFRFP 8 05/15/27 REGS	1'300	1'500	0	2'800 EUR	56.55%	1'543'139.77	0.27 a)	
X52154325489	3.3750 % SYNNVX 3 3/8 04/16/26 EMTN	2'050	0	0	2'050 EUR	96.60%	1'929'848.13	0.34 a)	
X52189356996	2.1250 % ARGID 2 1/8 08/15/26 REGS	2'500	0	0	2'500 EUR	88.77%	2'162'846.74	0.38 a)	
X52195511006	6.0000 % AMSSW 6 07/31/25 REGS	850	1'500	0	2'350 EUR	87.31%	1'999'500.90	0.35 a)	
X52198191962	6.6250 % THYLEE 6 5/8 07/15/28 REGS	3'000	0	0	3'000 EUR	82.85%	2'180'098.64	0.38 a)	
X52198388592	9.2500 % PRFINE 9 1/4 07/15/25 REGS	6'000	1'400	200	7'200 EUR	99.04%	6'949'356.60	1.21 a)	
X52202907510	3.3750 % SPMIM 3 3/8 07/15/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	93.82%	1'828'767.79	0.32 a)	
X52205083749	3.8750 % AVTR 3 7/8 07/15/28 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	92.07%	1'345'934.82	0.23 a)	
X52206382868	9.0000 % DBD 9 07/15/25 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52208646690	6.2500 % GAMENT 6 1/4 07/15/25 REGS	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52229875989	3.2500 % F 3 1/4 09/15/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	95.68%	2'797'445.18	0.49 a)	
X52231191748	4.8750 % CPIPGR 4 7/8 PERP	0	1'500	0	1'500 EUR	40.44%	591'117.85	0.10 a)	
X52231331260	3.7500 % ZFFNGR 3 3/4 09/21/28 EMTN	1'600	800	0	2'400 EUR	89.18%	2'085'946.06	0.36 a)	
X52232108568	5.8750 % MAXDIY 5 7/8 10/01/26 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	72.24%	1'407'985.91	0.24 a)	
X52237434803	3.2500 % UNIIM 3 1/4 09/23/30 EMTN	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52240463674	4.0000 % LORCAT 4 09/18/27 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	91.38%	1'781'130.64	0.31 a)	
X52240978085	2.5000 % VOV CAB 2 1/2 10/07/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	89.32%	1'305'675.18	0.23 a)	
X52242188261	7.5000 % CMACG 7 1/2 01/15/26 REGS	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52247614063	2.6250 % DRXLN 2 5/8 11/01/25	1'800	0	0	1'800 EUR	94.75%	1'662'117.66	0.29 a)	
X52247623643	3.5000 % GETFP 3 1/2 10/30/25	2'000	0	0	2'000 EUR	96.95%	1'889'776.10	0.33 a)	
X52249892535	2.6250 % ADEBNO 2 5/8 11/15/25 REGS	3'250	0	0	3'250 EUR	95.16%	3'014'000.30	0.52 a)	
X52249894234	3.0000 % ADEBNO 3 11/15/27 REGS	500	0	0	500 EUR	92.04%	448'493.88	0.08 a)	
X52251742537	2.6250 % AVTR 2 5/8 11/01/25 REGS	1'000	0	500	500 EUR	95.78%	466'718.41	0.08 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2256949749	3.2480 % ABESM 3.248 PERP	2'700	0	0	2'700 EUR	89.46%	2'354'109.72	0.41	a)
XS2264155305	7.6250 % CCL 7 5/8 03/01/26 REGS	2'500	0	500	2'000 EUR	93.25%	1'817'579.69	0.32	a)
XS2265369657	3.0000 % LHAGR 3 05/29/26 EMTN	3'400	0	2'400	1'000 EUR	94.45%	920'455.49	0.16	a)
XS2272845798	2.8750 % ZIGGO 2 7/8 01/15/29 REGS	3'600	0	0	3'600 EUR	74.34%	2'608'262.91	0.45	a)
XS2275090749	3.7500 % IMAIM 3 3/4 01/15/28 REGS	2'300	0	0	2'300 EUR	87.99%	1'972'402.39	0.34	a)
XS2282606578	2.6250 % ABESM 2 5/8 PERP	4'200	0	0	4'200 EUR	83.06%	3'399'778.42	0.59	a)
XS2287912450	5.2500 % VERISR 5 1/4 02/15/29 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	84.97%	1'656'131.83	0.29	a)
XS2288109676	1.6250 % TITIM 1 5/8 01/18/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	77.10%	1'127'094.32	0.20	a)
XS2291911282	7.2500 % MANTEN 7 1/4 02/01/26 REGS	4'300	100	1'400	3'000 EUR	90.75%	2'653'276.52	0.46	a)
XS2291928849	3.7500 % STYRO 3 3/4 07/15/26 REGS	1'800	0	0	1'800 EUR	88.06%	1'544'829.69	0.27	a)
XS2291929573	2.5000 % STYRO 2 1/2 01/15/26 REGS	2'800	500	0	3'300 EUR	90.34%	2'905'289.54	0.51	a)
XS2294854745	5.3750 % THOEUR 5 3/8 03/01/26 REGS	1'100	0	0	1'100 EUR	94.76%	1'015'899.38	0.18	a)
XS2298381307	4.2500 % KPERST 4 1/4 03/01/26 REGS	1'200	300	0	1'500 EUR	86.16%	1'259'538.87	0.22	a)
XS2298382453	6.5000 % KPERST 6 1/2 09/01/26 REGS	3'250	1'000	0	4'250 EUR	65.28%	2'703'981.14	0.47	a)
XS2301390089	1.8750 % ATLIM 1 7/8 02/12/28	0	1'500	0	1'500 EUR	84.16%	1'230'257.81	0.21	a)
XS2305744059	2.2500 % IQV 2 1/4 03/15/29 REGS	900	0	0	900 EUR	84.64%	742'382.38	0.13	a)
XS2307567086	3.6250 % VCPLN 3 5/8 08/24/26	0	1'850	0	1'850 EUR	81.72%	1'473'361.77	0.26	a)
XS2310487074	2.0000 % AMPBEV 2 09/01/28 REGS	2'100	0	0	2'100 EUR	83.00%	1'698'681.72	0.30	a)
XS2310511717	3.0000 % AMPBEV 3 09/01/29 REGS	1'650	0	0	1'650 EUR	73.43%	1'180'756.29	0.21	a)
XS2310951103	3.6250 % SAPSJ 3 5/8 03/15/28 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	88.91%	1'733'045.18	0.30	a)
XS2319950130	3.6250 % AHLMUN 3 5/8 02/04/28 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	84.27%	1'231'836.62	0.21	a)
XS2321537255	5.1250 % GAMENT 5 1/8 07/15/25 REGS	2'700	0	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2326493728	3.3750 % HNDLIN 3 3/8 04/15/29 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	86.71%	1'690'008.01	0.29	a)
XS2326497802	6.0000 % DOUGR 6 04/08/26 REGS	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2331728126	3.7500 % TIFSLN 3 3/4 04/15/29 REGS	2'800	0	0	2'800 EUR	79.30%	2'163'915.84	0.38	a)
XS2332975007	4.0000 % SFRFP 4 07/15/29 REGS	400	0	0	400 EUR	71.99%	280'638.20	0.05	a)
XS2336345140	5.5000 % CBRSR 5 1/2 04/15/26 REGS	3'400	0	0	3'400 EUR	91.03%	3'016'158.98	0.52	a)
XS2338564870	2.0000 % ZFFNGR 2 05/06/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	87.09%	848'707.38	0.15	a)
XS2342057143	3.6250 % UNSEAM 3 5/8 06/01/28 REGS	600	0	0	600 EUR	78.64%	459'848.64	0.08	a)
XS2342247355	6.5000 % TUICRU 6 1/2 05/15/26 REGS	4'200	0	0	4'200 EUR	91.61%	3'749'624.99	0.65	a)
XS2347397437	3.6250 % CITCON 3 5/8 PERP	0	500	0	500 EUR	51.22%	249'588.29	0.04	a)
XS2348767836	2.5000 % SNSPW 2 1/2 06/07/28 REGS	0	350	0	350 EUR	79.36%	270'680.50	0.05	a)
XS2349786835	3.5000 % PAPREC 3 1/2 07/01/28 REGS	2'700	0	0	2'700 EUR	89.63%	2'358'346.19	0.41	a)
XS2355632584	3.5000 % ATLNSA 3 1/2 04/30/28 REGS	3'000	0	1'500	1'500 EUR	72.90%	1'065'725.43	0.19	a)
XS2356039268	2.2500 % GTCAPW 2 1/4 06/23/26	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2357281174	4.0000 % NHHSM 4 07/02/26 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	94.85%	1'386'501.44	0.24	a)
XS2388186996	4.5000 % LHMCFI 4 1/2 03/15/27 REGS	4'700	0	0	4'700 EUR	90.99%	4'167'884.68	0.73	a)
XS2389112736	4.6250 % ITLYUM 4 5/8 10/01/26 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	91.96%	1'344'370.62	0.23	a)
XS2394823418	4.8750 % EOLOSP 4 7/8 10/21/28 REGS	1'500	0	500	1'000 EUR	75.07%	731'583.13	0.13	a)
XS2397198487	5.1250 % LORCAT 5 1/8 09/30/29 REGS	4'500	0	200	4'300 EUR	87.14%	3'651'872.34	0.64	a)
XS2397354528	4.6250 % GRAANU 4 5/8 10/15/26 REGS	2'200	0	0	2'200 EUR	84.77%	1'817'521.21	0.32	a)
XS2397447025	4.7500 % MODULA 4 3/4 11/30/28 REGS	4'300	0	0	4'300 EUR	83.18%	3'485'838.14	0.61	a)
XS2397448346	6.7500 % MODULA 6 3/4 11/30/29 REGS	4'000	0	0	4'000 EUR	74.28%	2'895'730.93	0.50	a)
XS2397781357	5.1250 % ILDFP 5 1/8 10/15/26 REGS	3'700	0	1'000	2'700 EUR	95.24%	2'506'070.10	0.44	a)
XS2397781944	5.6250 % ILDFP 5 5/8 10/15/28 REGS	2'500	0	0	2'500 EUR	91.29%	2'224'220.51	0.39	a)
XS2399700959	5.2500 % AGKLN 5 1/4 10/15/26 REGS	3'700	0	0	3'700 EUR	92.55%	3'337'353.09	0.58	a)
XS2401886788	4.5000 % LOXAM 4 1/2 02/15/27 REGS	2'950	0	0	2'950 EUR	95.08%	2'733'427.40	0.48	a)
XS2406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	1'700	0	700	1'000 EUR	90.48%	881'764.92	0.15	a)
XS2406607171	4.3750 % TEVA 4 3/8 05/09/30	6'650	0	200	6'450 EUR	83.41%	5'243'152.15	0.91	a)
XS2423013742	5.5000 % EDRSM 5 1/2 07/15/27 REGS	4'900	500	900	4'500 EUR	89.53%	3'926'322.98	0.68	a)
XS2431015655	3.5000 % ZIGGO 3 1/2 01/15/32 REGS	4'300	0	200	4'100 EUR	75.80%	3'028'779.71	0.53	a)
XS2434783911	5.2500 % ADRBID 5 1/4 02/01/30 REGS	2'850	0	0	2'850 EUR	77.53%	2'153'394.84	0.37	a)
XS2437324333	3.8750 % IPGIM 3 7/8 07/28/26	4'100	0	0	4'100 EUR	91.60%	3'659'948.63	0.64	a)
XS2442802349	6.3750 % PRMHLD 6 3/8 03/01/27 REGS	4'200	0	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	0	1'400	0	1'400 EUR	101.20%	1'380'803.11	0.24	a)
XS2486825669	4.2500 % VOVCAB 4 1/4 05/31/28 EMTN	2'450	0	0	2'450 EUR	94.37%	2'253'277.42	0.39	a)
XS2498543102	7.5580 % GAMHOL 7.558 07/15/27 REGS	0	3'550	0	3'550 EUR	91.94%	3'180'916.00	0.55	a)
XS2536848448	9.7500 % GAMENT 9 3/4 09/30/27 REGS	0	2'200	0	2'200 EUR	108.08%	2'317'302.03	0.40	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2541618299	9.0000 % HOUSEH 9 11/03/29 REGS	0	3'400	0	3'400 EUR	96.73%	3'205'031.34	0.56	a)
XS2548508881	11.0000 % FEDRIG 11 10/25/27 REGS	0	5'600	0	5'600 EUR	105.69%	5'768'259.21	1.00	a)
XS2550063478	7.5000 % SAZGR 7 1/2 08/21/26 REGS	0	1'250	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2550380104	10.3750 % LHMCFI 10 3/8 11/30/27 REGS	0	3'400	0	3'400 EUR	107.44%	3'560'144.50	0.62	a)
XS2553240396	11.0000 % FEDRIG 11 10/25/27 REGS	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2553825949	7.2500 % EOFF 7 1/4 06/15/26	0	3'550	0	3'550 EUR	103.98%	3'597'502.83	0.63	a)
XS2566291865	9.2500 % INTRUM 9 1/4 03/15/28 REGS	0	3'200	0	3'200 EUR	90.54%	2'823'581.30	0.49	a)
XS2566349887	7.5580 % GAMHOL 7.558 07/15/27 DEC	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2581393134	6.8750 % TITIM 6 7/8 02/15/28	0	7'200	2'000	5'200 EUR	100.29%	5'082'327.55	0.88	a)
XS2581396079	9.0150 % LIMACO FLOAT 02/01/28 REGS	0	2'200	0	2'200 EUR	98.32%	2'108'127.36	0.37	a)
XS2582788100	10.0000 % FIREBC 10 02/06/28 REGS	0	2'500	0	2'500 EUR	97.94%	2'386'145.90	0.42	a)
XS2586123965	4.8670 % F 4.867 08/03/27	0	4'700	0	4'700 EUR	97.41%	4'461'631.87	0.78	a)
XS2587558474	6.6250 % INEGRP 6 5/8 05/15/28 REGS	0	1'700	0	1'700 EUR	99.21%	1'643'653.39	0.29	a)
XS2615006470	8.7500 % CABBCO 8 3/4 05/01/28 REGS	0	3'000	0	3'000 EUR	100.15%	2'928'106.26	0.51	a)
XS2615562274	6.7500 % GRUPHA 6 3/4 05/15/30 REGS	0	2'900	0	2'900 EUR	101.02%	2'855'204.26	0.50	a)
XS2615937187	7.2500 % SAZKAG 7 1/4 04/30/30 REGS	0	2'500	0	2'500 EUR	100.30%	2'443'767.57	0.43	a)
XS2619047728	9.3750 % BENTLR 9 3/8 05/15/28 REGS	0	2'400	0	2'400 EUR	101.56%	2'375'487.97	0.41	a)
XS2623489627	8.5000 % DAN 8 1/2 07/15/31 REGS	0	3'800	0	3'800 EUR	100.04%	3'704'675.71	0.64	a)
XS2623496085	6.1250 % F 6 1/8 05/15/28	0	3'800	0	3'800 EUR	100.90%	3'736'710.31	0.65	a)
XS2623604233	9.5000 % PELHOL 9 1/2 04/01/27 REGS	0	5'200	0	5'200 EUR	90.71%	4'596'934.84	0.80	a)
XS2624554320	6.2500 % OI 6 1/4 05/15/28 REGS	0	1'200	0	1'200 EUR	102.35%	1'196'924.47	0.21	a)
<b>EUR</b>							<b>301'797'138.12</b>	<b>52.51</b>	
FR0011401728	6.0000 % EDF 6 PERP EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	90.11%	1'531'348.10	0.27	a)
FR0011700293	5.8750 % EDF 5 7/8 PERP EMTN	3'500	0	0	3'500 GBP	82.57%	3'274'266.50	0.57	a)
XS0593952111	6.8750 % TDCDC 6 7/8 02/23/23 EMTN	350	0	350	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1554448271	7.3750 % NEMEAN 7 3/8 02/01/24 REGS	4'750	0	4'750	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1713495759	3.8750 % IRM 3 7/8 11/15/25 REGS	1'200	0	0	1'200 GBP	94.49%	1'284'628.83	0.22	a)
XS1732478000	4.0000 % OSPRAQ 4 03/08/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	92.78%	1'366'524.16	0.24	a)
XS1820760079	6.6250 % ATALIA 6 5/8 05/15/25 REGS	2'000	0	0	2'000 GBP	68.06%	1'542'145.57	0.27	a)
XS1996438948	5.2500 % VMED 5 1/4 05/15/29 REGS	1'500	0	0	1'500 GBP	82.63%	1'404'225.78	0.24	a)
XS2052466815	3.2500 % PINEFI 3 1/4 09/30/25 REGS	1'200	0	0	1'200 GBP	93.24%	1'267'729.04	0.22	a)
XS2187646901	4.8750 % VMED 4 7/8 07/15/28 REGS	3'000	0	0	3'000 GBP	78.45%	2'666'373.68	0.46	a)
XS2199627030	3.6250 % BMELN 3 5/8 07/15/25	2'050	0	0	2'050 GBP	94.37%	2'191'787.08	0.38	a)
XS2210014788	8.2500 % STONPB 8 1/4 07/31/25 REGS	350	0	350	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2230739059	6.5000 % CPKLN 6 1/2 08/28/26	2'550	100	0	2'650 GBP	94.67%	2'842'533.27	0.49	a)
XS2258560361	4.6250 % THAMES 4 5/8 05/19/26 REGS	1'750	100	0	1'850 GBP	87.22%	1'828'212.71	0.32	a)
XS2291336167	6.5000 % AABOND 6 1/2 01/31/26 REGS	1'800	0	1'800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2303071992	3.2500 % ASSDLN 3 1/4 02/16/26 REGS	3'300	0	750	2'550 GBP	84.92%	2'453'489.68	0.43	a)
XS2329602135	4.3750 % GTWICK 4 3/8 04/07/26	3'400	0	0	3'400 GBP	91.65%	3'530'456.50	0.61	a)
XS2358483258	4.5000 % VMED 4 1/2 07/15/31 REGS	4'900	200	3'500	1'600 GBP	74.33%	1'347'360.64	0.23	a)
XS2364423652	6.7500 % PIZEXP 6 3/4 07/15/26 REGS	3'100	0	2'500	600 GBP	81.27%	552'438.26	0.10	a)
XS2370618618	6.5000 % SHODFP 6 1/2 08/01/26 REGS	4'250	0	200	4'050 GBP	76.59%	3'514'301.65	0.61	a)
XS2404741238	4.5000 % ASSDLN 4 1/2 02/16/26 REGS	0	250	250	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2411236859	3.6250 % PINEFI 3 5/8 11/15/27 REGS	1'350	0	0	1'350 GBP	89.05%	1'362'030.69	0.24	a)
XS2558411224	13.2500 % NEMEAN 13 1/4 12/15/26 REGS	0	4'745	0	4'745 GBP	99.79%	5'364'729.67	0.93	a)
XS2615792194	10.2500 % TRAVEL 10 1/4 04/28/28 REGS	0	2'800	0	2'800 GBP	97.09%	3'079'917.77	0.54	a)
<b>GBP</b>							<b>42'404'499.58</b>	<b>7.38</b>	
BE6300372289	5.5000 % TNETBB 5 1/2 03/01/28 144A	4'200	0	0	4'200 USD	93.02%	3'571'284.21	0.62	a)
US00253XAA90	5.5000 % AAL 5 1/2 04/20/26 144A	2'500	400	0	2'900 USD	98.15%	2'601'911.32	0.45	a)
US019576AC18	6.0000 % UNSEAM 6 06/01/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	73.99%	676'388.73	0.12	a)
US02156LAA98	8.1250 % SFRFP 8 1/8 02/01/27 144A	2'750	0	0	2'750 USD	86.22%	2'167'369.66	0.38	a)
US02156TAA25	6.0000 % SFRFP 6 02/15/28 144A	2'000	1'000	0	3'000 USD	49.89%	1'368'153.46	0.24	a)
US02156TAB08	10.5000 % SFRFP 10 1/2 05/15/27 144A	4'000	0	0	4'000 USD	59.69%	2'182'661.11	0.38	a)
US02376RAC60	5.0000 % AAL 5 06/01/22 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023771S586	11.7500 % AAL 11 3/4 07/15/25 144A	6'650	0	2'000	4'650 USD	109.61%	4'659'214.12	0.81	a)
US023771T329	7.2500 % AAL 7 1/4 02/15/28 144A	0	250	0	250 USD	97.92%	223'783.92	0.04	a)
US03674XAN66	8.3750 % AR 8 3/8 07/15/26 144A	1'523	0	0	1'523 USD	104.75%	1'458'340.58	0.25	a)
US03674XAS53	5.3750 % AR 5 3/8 03/01/30 144A	1'000	0	0	1'000 USD	91.96%	840'670.62	0.15	a)
US037411BF15	4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	2'000	0	0	2'000 USD	89.76%	1'641'100.36	0.29	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US045054AF03	4.3750 % AHTLN 4 3/8 08/15/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	94.23%	861'394.40	0.15	a)
US053773BC09	5.7500 % CAR 5 3/4 07/15/27 144A	2'000	0	0	2'000 USD	94.43%	1'726'536.82	0.30	a)
US058498AW66	2.8750 % BALL 2 7/8 08/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	82.79%	2'270'501.78	0.40	a)
US071734AC18	5.7500 % BHCCN 5 3/4 08/15/27 144A	2'000	0	0	2'000 USD	63.06%	1'152'999.11	0.20	a)
US071734AM99	5.0000 % BHCCN 5 02/15/29 144A	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US097751BM26	7.5000 % BBDBCN 7 1/2 03/15/25 144A	868	0	868	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US097751BR13	7.5000 % BBDBCN 7 1/2 12/01/24 144A	1'201	0	1'201	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12429TAD63	5.5000 % BWY 5 1/2 04/15/24 144A	250	250	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12429TAE47	7.2500 % BWY 7 1/4 04/15/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US1248EPBT92	5.1250 % CHTR 5 1/8 05/01/27 144A	1'500	0	0	1'500 USD	92.83%	1'272'880.74	0.22	a)
US1248EPCQ45	4.7500 % CHTR 4 3/4 02/01/32 144A	1'000	0	0	1'000 USD	80.26%	733'705.93	0.13	a)
US12543DBC39	8.0000 % CYH 8 03/15/26 144A	0	2'500	0	2'500 USD	93.35%	2'133'397.56	0.37	a)
US12543DBE94	6.8750 % CYH 6 7/8 04/01/28 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12543DBK54	4.7500 % CYH 4 3/4 02/15/31 144A	0	1'500	0	1'500 USD	71.83%	984'964.63	0.17	a)
US126307AH04	5.2500 % CSCHL 5 1/4 06/01/24	1'500	0	0	1'500 USD	92.80%	1'272'441.95	0.22	a)
US126307BM89	11.2500 % CSCHL 11 1/4 05/15/28 144A	0	1'000	0	1'000 USD	94.46%	863'496.95	0.15	a)
US14366RAA77	10.3750 % CCL 10 3/8 05/01/28 144A	0	500	0	500 USD	108.26%	494'824.82	0.09	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	1'500	0	0	1'500 USD	92.68%	1'270'892.47	0.22	a)
US156700BA34	7.5000 % LUMN 7 1/2 04/01/24 Y	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BL78	5.3750 % CHTR 5 3/8 05/01/47	0	1'000	0	1'000 USD	79.52%	726'904.66	0.13	a)
US16411QAG64	4.5000 % CQP 4 1/2 10/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	92.15%	842'398.37	0.15	a)
US17302WAB46	9.2500 % CITHOL 9 1/4 08/01/24 144A	2'500	400	0	2'900 USD	100.34%	2'659'968.99	0.46	a)
US20338QAA13	8.2500 % COMM 8 1/4 03/01/27 144A	0	1'000	0	1'000 USD	77.89%	712'013.15	0.12	a)
US20338QAD51	6.0000 % COMM 6 03/01/26 144A	2'250	500	0	2'750 USD	93.99%	2'362'876.64	0.41	a)
US20903XAF06	6.5000 % CNSL 6 1/2 10/01/28 144A	0	3'252	0	3'252 USD	74.83%	2'224'647.25	0.39	a)
US23311RAH93	5.8500 % DCP 5.85 05/21/43 144A	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US23585WAA27	8.5000 % DAC 8 1/2 03/01/28 144A	2'400	0	1'000	1'400 USD	99.32%	1'271'145.69	0.22	a)
US24703TAD81	6.0200 % DELL 6.02 06/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	102.30%	1'870'314.33	0.33	a)
US25470XAW56	5.8750 % DISH 5 7/8 11/15/24	0	600	0	600 USD	85.65%	469'759.75	0.08	a)
US25470XBB01	7.3750 % DISH 7 3/8 07/01/28	3'500	0	0	3'500 USD	51.50%	1'647'755.38	0.29	a)
US25470XBE40	5.2500 % DISH 5 1/4 12/01/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	79.17%	2'171'170.24	0.38	a)
US26151AAA79	6.6250 % DRXLN 6 5/8 11/01/25 144A	3'250	0	0	3'250 USD	98.10%	2'914'449.61	0.51	a)
US268317AM62	5.6250 % EDF 5 5/8 PERP 144A	800	0	0	800 USD	97.45%	712'693.28	0.12	a)
US26884LAG41	7.0000 % EQT 7 02/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	103.99%	950'633.73	0.17	a)
US26884LAH24	6.1250 % EQT 6 1/8 02/01/25	1'950	0	0	1'950 USD	100.03%	1'783'144.93	0.31	a)
US279158AP43	4.6250 % ECOPET 4 5/8 11/02/31	0	1'000	0	1'000 USD	76.26%	697'112.51	0.12	a)
US279158AS81	8.8750 % ECOPET 8 7/8 01/13/33	0	3'600	0	3'600 USD	97.66%	3'213'932.00	0.56	a)
US28228PAA93	6.7500 % EGBLFN 6 3/4 02/07/25 144A	2'000	0	0	2'000 USD	96.15%	1'757'983.58	0.31	a)
US28228PAB76	8.5000 % EGBLFN 8 1/2 10/30/25 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29273DAA81	5.8750 % ENDP 5 7/8 10/15/24 144A	1'050	0	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30015DAA90	9.7500 % EVRGRN 9 3/4 04/26/28 144A	0	1'600	0	1'600 USD	100.26%	1'466'443.01	0.26	a)
US30251GBE61	6.1250 % FMGAU 6 1/8 04/15/32 144A	2'000	0	0	2'000 USD	94.72%	1'731'674.35	0.30	a)
US345370CS72	5.2910 % F 5.291 12/08/46	2'250	1'000	0	3'250 USD	78.96%	2'345'862.02	0.41	a)
US345370DB39	6.1000 % F 6.1 08/19/32	0	500	0	500 USD	93.95%	429'440.25	0.07	a)
US345397A456	4.2710 % F 4.271 01/09/27	600	0	0	600 USD	91.81%	503'568.67	0.09	a)
US345397C270	4.9500 % F 4.95 05/28/27	3'200	0	0	3'200 USD	93.81%	2'744'146.66	0.48	a)
US345397C353	7.3500 % F 7.35 11/04/27	0	2'800	0	2'800 USD	101.28%	2'592'255.16	0.45	a)
US345397C684	7.3500 % F 7.35 03/06/30	0	500	0	500 USD	100.91%	461'243.52	0.08	a)
US35906ABG22	6.7500 % FYBR 6 3/4 05/01/29 144A	0	2'000	0	2'000 USD	73.77%	1'348'791.76	0.23	a)
US361841AP42	4.0000 % GLPI 4 01/15/30	2'300	0	0	2'300 USD	87.22%	1'833'818.72	0.32	a)
US37185LAF94	5.6250 % GEL 5 5/8 06/15/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44963BAD01	6.3750 % IHOVER 6 3/8 05/15/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	93.00%	850'159.50	0.15	a)
US449691AA27	6.5000 % ILDFP 6 1/2 10/15/26 144A	1'500	0	0	1'500 USD	94.02%	1'289'239.46	0.22	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	1'250	0	0	1'250 USD	90.13%	1'029'881.39	0.18	a)
US50077LBJ44	5.5000 % KHC 5 1/2 06/01/50	1'000	0	0	1'000 USD	98.50%	900'465.17	0.16	a)
US501797AN49	5.2500 % BBWI 5 1/4 02/01/28	1'100	0	0	1'100 USD	95.19%	957'147.05	0.17	a)
US527298BM48	5.2500 % LVLT 5 1/4 03/15/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US527298BN21	4.6250 % LVLT 4 5/8 09/15/27 144A	2'250	0	0	2'250 USD	62.40%	1'283'363.76	0.22	a)
US55616XAJ63	4.3000 % M 4.3 02/15/43	3'000	0	0	3'000 USD	57.98%	1'590'154.78	0.28	a)
US57763RAC16	9.2500 % BWY 9 1/4 04/15/27 144A	0	500	0	500 USD	91.28%	417'204.35	0.07	a)
US599191AA16	6.5000 % UAL 6 1/2 06/20/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.83%	775'729.86	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US603051AC70	8.0000 % MINAU 8 11/01/27 144A	1'800	0	0	1'800 USD	100.17%	1'648'267.13	0.29	a)
US62828M2B67	4.4000 % MUTHIN 4.4 09/02/23 REGS	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US629571AA86	7.2500 % NBR 7 1/4 01/15/26 144A	3'950	0	0	3'950 USD	91.72%	3'311'910.60	0.58	a)
US644393AB64	6.5000 % NFE 6 1/2 09/30/26 144A	2'250	0	500	1'750 USD	88.68%	1'418'717.38	0.25	a)
US66977WAQ24	4.8750 % NCX 4 7/8 06/01/24 144A	700	0	0	700 USD	98.14%	628'015.57	0.11	a)
US674599CF00	4.6250 % OXY 4 5/8 06/15/45	700	0	0	700 USD	77.55%	496'271.92	0.09	a)
US674599CJ22	4.4000 % OXY 4.4 04/15/46	1'200	0	0	1'200 USD	75.77%	831'137.87	0.14	a)
US674599CM50	3.0000 % OXY 3 02/15/27	450	0	0	450 USD	89.88%	369'728.88	0.06	a)
US674599CW33	2.9000 % OXY 2.9 08/15/24	500	0	0	500 USD	96.24%	439'893.55	0.08	a)
US674599DK85	4.5000 % OXY 4 1/2 07/15/44	1'340	0	0	1'340 USD	77.50%	949'344.78	0.17	a)
US674599EB77	5.8750 % OXY 5 7/8 09/01/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.99%	914'031.16	0.16	a)
US674599EC50	6.3750 % OXY 6 3/8 09/01/28	1'250	0	0	1'250 USD	102.90%	1'175'825.44	0.20	a)
US69888XAA72	7.5000 % ENDP 7 1/2 04/01/27 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US71647NBD03	6.9000 % PETBRA 6.9 03/19/49	3'900	0	0	3'900 USD	91.20%	3'251'520.02	0.57	a)
US71647NBJ72	5.5000 % PETBRA 5 1/2 06/10/51	1'500	0	0	1'500 USD	78.03%	1'069'980.58	0.19	a)
US71654QCG55	6.5000 % PEMEX 6 1/2 03/13/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US740212AL91	7.1250 % PDCN 7 1/8 01/15/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	97.97%	895'574.47	0.16	a)
US74166MAB28	5.2500 % PRSESE 5 1/4 04/15/24 144A	500	0	121	379 USD	99.06%	343'202.63	0.06	a)
US75281ABA60	5.0000 % RRC 5 03/15/23	820	0	820	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US75281ABJ79	8.2500 % RRC 8 1/4 01/15/29	1'250	0	0	1'250 USD	104.11%	1'189'686.24	0.21	a)
US780153AU63	5.2500 % RCL 5 1/4 11/15/22	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780153AY85	10.8750 % RCL 10 7/8 06/01/23 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780153BC56	9.1250 % RCL 9 1/8 06/15/23 144A	5'100	0	5'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780153BG60	5.5000 % RCL 5 1/2 04/01/28 144A	100	0	0	100 USD	92.00%	84'099.97	0.01	a)
US780153BK72	5.3750 % RCL 5 3/8 07/15/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	92.48%	845'442.49	0.15	a)
US780153BL55	11.6250 % RCL 11 5/8 08/15/27 144A	0	600	0	600 USD	108.70%	596'186.69	0.10	a)
US78454LAN01	6.7500 % SM 6 3/4 09/15/26	3'000	0	0	3'000 USD	97.06%	2'661'794.55	0.46	a)
US78454LAT70	10.0000 % SM 10 01/15/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80627DAC02	4.7500 % IHOVER 4 3/4 09/15/26 144A	2'700	0	0	2'700 USD	90.55%	2'235'058.36	0.39	a)
US830867AA59	4.5000 % DAL 4 1/2 10/20/25 144A	850	0	154	696 USD	98.21%	625'124.57	0.11	a)
US845467AN98	7.7500 % SWN 7 3/4 10/01/27	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US852061AS99	6.0000 % S 6 11/15/22	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US85207UAH86	7.1250 % S 7 1/8 06/15/24	2'500	0	0	2'500 USD	101.04%	2'309'097.19	0.40	a)
US85207UAK16	7.6250 % S 7 5/8 03/01/26	2'000	0	0	2'000 USD	104.69%	1'914'102.12	0.33	a)
US85858EAB92	6.1250 % STENA 6 1/8 02/01/25 144A	1'300	0	0	1'300 USD	97.58%	1'159'600.19	0.20	a)
US88033GCY44	4.8750 % THC 4 7/8 01/01/26 144A	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GCZ19	4.8750 % THC 4 7/8 01/01/26	0	2'250	0	2'250 USD	96.89%	1'992'931.56	0.35	a)
US88033GDA58	5.1250 % THC 5 1/8 11/01/27 144A	750	100	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GDB32	5.1250 % THC 5 1/8 11/01/27	0	850	0	850 USD	95.49%	742'006.87	0.13	a)
US88033GDJ67	6.1250 % THC 6 1/8 10/01/28 144A	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GDK31	6.1250 % THC 6 1/8 10/01/28	0	1'500	0	1'500 USD	94.79%	1'299'743.04	0.23	a)
US88033GDP28	6.1250 % THC 6 1/8 06/15/30 144A	0	2'400	0	2'400 USD	96.76%	2'122'919.58	0.37	a)
US880349AS45	7.8750 % TEN 7 7/8 01/15/29 144A	3'250	0	3'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88167AAK79	6.7500 % TEVA 6 3/4 03/01/28	500	0	0	500 USD	97.86%	447'289.02	0.08	a)
US88167AAN19	7.1250 % TEVA 7 1/8 01/31/25	500	0	0	500 USD	101.81%	465'366.34	0.08	a)
US893800AA08	5.8750 % RIG 5 7/8 01/15/24 144A	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US893829AA96	6.2500 % RIG 6 1/4 12/01/24 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89686QAB23	8.5000 % TRIVIU 8 1/2 08/15/27 144A	0	1'000	0	1'000 USD	94.23%	861'385.26	0.15	a)
US90320BAA70	4.8750 % UPCB 4 7/8 07/15/31 144A	3'000	0	0	3'000 USD	84.25%	2'310'568.97	0.40	a)
US910047AH22	5.0000 % UAL 5 02/01/24	1'000	0	0	1'000 USD	99.33%	907'979.49	0.16	a)
US91327TAA97	10.5000 % UNIT 10 1/2 02/15/28 144A	0	1'500	0	1'500 USD	97.07%	1'331'089.24	0.23	a)
US914906AT95	9.5000 % UVN 9 1/2 05/01/25 144A	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91911KAP75	9.0000 % BHCCN 9 12/15/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91911XAW48	8.5000 % BHCCN 8 1/2 01/31/27 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92769XAP06	5.5000 % VMED 5 1/2 05/15/29 144A	4'000	0	200	3'800 USD	89.92%	3'123'509.77	0.54	a)
US92857WBQ24	7.0000 % VOD 7 04/04/2079	2'000	0	0	2'000 USD	101.31%	1'852'214.16	0.32	a)
US92857WBX74	5.1250 % VOD 5 1/8 06/04/2081	3'850	0	0	3'850 USD	74.50%	2'621'834.76	0.46	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	2'750	0	0	2'750 USD	95.31%	2'396'060.28	0.42	a)
US984121CQ49	4.6250 % XRRCRP 3 5/8 03/15/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98877DAE58	7.1250 % ZFFNGR 7 1/8 04/14/30 144A	0	700	0	700 USD	100.84%	645'254.67	0.11	a)
USA35155AA77	5.7500 % KLAB 5 3/4 04/03/29 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	98.05%	1'344'540.96	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USA35155AB50	7.0000 % KLAB 7 04/03/49 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC3535CAH19	6.5000 % FMCN 6 1/2 03/01/24 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG05891AH20	10.5000 % ASTONM 10 1/2 11/30/25 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	100.86%	3'688'193.02	0.64	a)
USG4289TAA19	5.5000 % HBRLN 5 1/2 10/15/26 REGS	6'800	0	800	6'000 USD	92.33%	5'064'098.47	0.88	a)
USG4923NAB40	6.2500 % CMIENE 6 1/4 04/26/29 REGS	1'400	0	0	1'400 USD	93.50%	1'196'609.55	0.21	a)
USG49774AB18	9.0000 % IAECN 9 07/15/26 REGS	6'800	200	800	6'200 USD	95.04%	5'386'837.30	0.94	a)
USG5002FAU06	5.8750 % TTMTIN 5 7/8 01/15/28 REGS	2'750	0	0	2'750 USD	89.41%	2'247'588.61	0.39	a)
USG53431AA32	6.7500 % LILAPR 6 3/4 10/15/27 REGS	1'575	0	0	1'575 USD	92.96%	1'338'353.31	0.23	a)
USG53901AA58	10.8750 % LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS	0	4'500	0	4'500 USD	95.85%	3'943'080.90	0.69	a)
USG64252AA01	6.6250 % NEPENE 6 5/8 05/15/25 REGS	4'850	0	0	4'850 USD	98.57%	4'370'270.96	0.76	a)
USG91237AB60	10.2500 % TLWLN 10 1/4 05/15/26 REGS	5'568	262	1'771	4'059 USD	74.42%	2'761'387.94	0.48	a)
USL56608AP43	3.6250 % JBSSBZ 3 5/8 01/15/32 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	80.96%	1'036'095.78	0.18	a)
USL5831KAA45	6.8750 % WOMCHI 6 7/8 11/26/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USL5559NAA30	3.6250 % JBSSBZ 3 5/8 01/15/32 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USL626A6AA24	7.2500 % MCBRAC 7 1/4 06/30/31 REGS	2'100	0	0	2'100 USD	73.32%	1'359'977.33	0.24	a)
USL6364EAA12	4.8750 % EKT 4 7/8 01/15/28 REGS	900	0	0	900 USD	89.96%	703'110.15	0.12	a)
USL6401PAJ23	4.3750 % BEEFBZ 4 3/8 03/18/31 REGS	200	0	0	200 USD	77.38%	141'470.20	0.02	a)
USL65266AA36	5.2500 % MOVIBZ 5 1/4 02/08/31 REGS	2'500	750	0	3'250 USD	77.56%	2'304'149.36	0.40	a)
USL95806AA06	5.8750 % USIM 5 7/8 07/18/26 REGS	870	0	870	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP1905CAJ91	5.7500 % BRFSBZ 5 3/4 09/21/50 REGS	200	0	0	200 USD	67.60%	123'598.56	0.02	a)
USP2253TJP59	7.3750 % CEMEX 7 3/8 06/05/27 REGS	2'300	0	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP4955MAA91	5.7500 % GAXO 5 3/4 06/08/26 REGS	0	1'200	0	1'200 USD	88.17%	967'251.15	0.17	a)
USP5865GAC44	7.5000 % INVTLA 7 1/2 05/19/26 REGS	4'200	0	1'000	3'200 USD	93.99%	2'749'587.68	0.48	a)
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	1'400	450	0	1'850 USD	75.10%	1'270'057.39	0.22	a)
USP9810XAB75	4.3750 % VTRCOM 4 3/8 04/15/29 REGS	0	3'906	2'750	1'156 USD	46.33%	489'595.70	0.09	a)
USQ4935RAA25	12.0000 % INFRAB 12 10/01/24 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU63768AB83	6.6250 % MRFBZ 6 5/8 08/06/29 REGS	2'200	0	0	2'200 USD	89.78%	1'805'512.07	0.31	a)
USU7024RAA24	7.5000 % ENDP 7 1/2 04/01/27 REGS	516	0	516	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USV3856JAA17	5.5000 % GRNKEN 5 1/2 04/06/25 REGS	3'150	0	0	3'150 USD	94.83%	2'730'612.21	0.48	a)
XS2203824789	11.2500 % KAISAG 11 1/4 04/16/25	2'500	0	0	2'500 USD	7.35%	167'952.21	0.03	a)
XS2383328932	4.3750 % ADANIG 4 3/8 09/08/24 REGS	4'000	200	4'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2449192942	8.0000 % ZHPRHK 8 03/06/23	2'000	0	0	2'000 USD	6.29%	115'018.35	0.02	a)

**USD** **191'757'125.30** **33.37**

**Nicht kotierte Wertpapiere** **1'110'143.76** **0.19**

**Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte** **1'110'143.76** **0.19**

XS1577965004	7.7500 % MHPSA 7 3/4 05/10/24 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	60.72%	1'110'143.76	0.19	c)
--------------	------------------------------------	-------	---	---	-----------	--------	--------------	------	----

**USD** **1'110'143.76** **0.19**

**Derivative Finanzinstrumente** **-2'383'580.83** **-0.41**

**Devisentermingeschäfte**

GBP/CHF	Verfall 17.06.2022	60'647'189	49'565'000		CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 17.06.2022	248'156'650	264'892'562		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 17.06.2022	300'737'432	290'827'485		CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 17.06.2022	2'989'565	2'800'000		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 17.06.2022	5'000'000	5'159'705		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 17.06.2022	200'000	244'764		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 17.06.2022	2'000'000	1'956'328		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 17.06.2022	5'000'000	5'016'490		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 17.06.2022	6'000'000	6'281'304		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 17.06.2022	1'500'000	1'840'743		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 17.06.2022	2'000'000	2'005'718		USD/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 16.09.2022	292'756'634	279'827'485		CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 16.09.2022	57'409'281	47'865'000		CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 16.09.2022	250'699'200	252'902'997		CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 16.09.2022	20'000'000	19'891'640		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022	10'000'000	10'422'270		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022	4'000'000	4'807'072		GBP/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022		3'000'000	3'032'682		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.09.2022		5'300'000	5'059'581		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022		400'000	466'333		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.09.2022		1'700'000	1'616'071		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.09.2022		2'000'000	1'901'260		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022		300'000	346'476		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022		3'006'163	3'000'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022		4'000'000	3'992'640		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022		750'000	862'967		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.09.2022		2'000'000	1'913'918		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022		3'000'000	3'001'374		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022		700'000	807'246		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.09.2022		700'000	814'257		GBP/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.09.2022		10'435'040	11'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 16.09.2022		2'315'752	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.09.2022		14'605'935	15'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.09.2022		5'000'000	4'868'350		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.09.2022		3'000'000	2'945'163		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.12.2022		219'296'882	229'902'997		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.12.2022		255'518'771	266'821'322		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 16.12.2022		47'285'658	43'015'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.12.2022		4'500'000	4'416'368		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.12.2022		1'500'000	1'588'623		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.12.2022		2'500'000	2'375'725		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.12.2022		5'000'000	4'740'255		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.12.2022		2'500'000	2'441'975		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.12.2022		600'000	631'853		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.12.2022		1'400'000	1'352'393		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.12.2022		1'600'000	1'572'125		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.12.2022		500'000	548'957		GBP/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.12.2022		4'685'835	5'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.12.2022		14'649'990	15'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.12.2022		2'353'258	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.12.2022		3'436'311	3'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.12.2022		5'929'572	6'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.12.2022		1'877'644	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 08.02.2023		3'000'000	2'995'203		EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.03.2023		211'704'511	230'802'997		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		277'695'848	282'421'322		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 17.03.2023		46'017'004	40'415'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 17.03.2023		2'268'036	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.03.2023		6'429'927	7'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		2'456'510	2'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.03.2023		1'500'000	1'381'740		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.03.2023		3'000'000	2'770'206		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.03.2023		2'754'717	3'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		10'012'780	10'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		3'005'265	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		2'990'214	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		1'983'946	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		3'968'412	4'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 17.03.2023		4'000'000	4'442'324		GBP/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		2'460'010	2'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.03.2023		3'000'000	2'758'263		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.03.2023		1'607'503	1'500'000		USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.03.2023		1'986'642	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.06.2023		3'000'000	2'907'858		EUR/CHF	13'273.65	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 16.06.2023		2'000'000	1'829'948		USD/CHF	-4'752.29	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 16.06.2023		301'661'378	311'421'322		CHF/EUR	-1'572'744.28	-0.27	b)
USD/CHF	Verfall 16.06.2023		211'820'423	231'695'494		CHF/USD	375'706.90	0.07	b)
GBP/CHF	Verfall 16.06.2023		42'280'164	38'415'000		CHF/GBP	-1'180'292.83	-0.21	b)
CHF/EUR	Verfall 16.06.2023		1'500'000	1'469'013		EUR/CHF	-8'439.03	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 16.06.2023		2'938'479	3'000'000		CHF/EUR	17'330.81	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 16.06.2023		2'930'697	3'000'000		CHF/EUR	9'553.01	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 16.06.2023		1'498'249	1'360'000		CHF/GBP	-40'374.79	-0.01	b)
EUR/CHF	Verfall 16.06.2023		2'432'820	2'500'000		CHF/EUR	-1'461.56	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 16.06.2023		700'000	782'900		GBP/CHF	9'045.68	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 16.06.2023		1'000'000	1'027'435		CHF/EUR	-426.10	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-2'383'580.83</b>	<b>-0.41</b>	

#### Kreditderivate

0.00 0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
12/26	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/26	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.38 06/27	2'000	0	2'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.38 06/27	10'000	0	10'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.38 06/27	0	2'000	2'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	25'145'997.61	4.38
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	542'862'534.26	94.46
Derivative Finanzinstrumente	-2'383'580.83	-0.41
Sonstige Vermögenswerte	9'084'266.89	1.58
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'709'217.93</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-610.90	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'708'607.03</b>	

## 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);	541'752'390.50	94.27
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-2'383'580.83	-0.41
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	1'110'143.76	0.19

## Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>61'777'823.30</b>	<b>10.75</b>
BE6300372289 5.5000 % TNETBB 5 1/2 03/01/28 144A	800 USD 93.02%	680'244.61 0.12
BE6342263157 5.7500 % AZELIS 5 3/4 03/15/28 REGS	1'000 EUR 101.10%	985'254.89 0.17
US02156TAA25 6.0000 % SFRFP 6 02/15/28 144A	1'400 USD 49.89%	638'471.61 0.11
US037411BF15 4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	2'000 USD 89.76%	1'641'100.36 0.29
US053773BC09 5.7500 % CAR 5 3/4 07/15/27 144A	1'600 USD 94.43%	1'381'229.46 0.24
US23585WAA27 8.5000 % DAC 8 1/2 03/01/28 144A	1'400 USD 99.32%	1'271'145.69 0.22
US345370CS72 5.2910 % F 5.291 12/08/46	1'000 USD 78.96%	721'803.70 0.13
US345397C270 4.9500 % F 4.95 05/28/27	500 USD 93.81%	428'772.92 0.07
US71647NBJ72 5.5000 % PETBRA 5 1/2 06/10/51	1'400 USD 78.03%	998'648.54 0.17
US88033GDK31 6.1250 % THC 6 1/8 10/01/28	220 USD 94.79%	190'628.98 0.03
US88167AAK79 6.7500 % TEVA 6 3/4 03/01/28	500 USD 97.86%	447'289.02 0.08
US910047AH22 5.0000 % UAL 5 02/01/24	655 USD 99.33%	594'726.56 0.10
USG4289TAA19 5.5000 % HBRLN 5 1/2 10/15/26 REGS	500 USD 92.33%	422'008.21 0.07
USG49774AB18 9.0000 % IAECN 9 07/15/26 REGS	1'450 USD 95.04%	1'259'824.85 0.22
USG5002FAU06 5.8750 % TTMTIN 5 7/8 01/15/28 REGS	500 USD 89.41%	408'652.47 0.07
USG53901AA58 10.8750 % LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS	583 USD 95.85%	510'848.04 0.09
USL56608AP43 3.6250 % JBSSBZ 3 5/8 01/15/32 REGS	1'000 USD 80.96%	740'068.42 0.13
USL65266AA36 5.2500 % MOVIBZ 5 1/4 02/08/31 REGS	2'400 USD 77.56%	1'701'525.68 0.30
USP4955MAA91 5.7500 % GAXO 5 3/4 06/08/26 REGS	500 USD 88.17%	403'021.31 0.07
USP5865GAC44 7.5000 % INVTLA 7 1/2 05/19/26 REGS	200 USD 93.99%	171'849.23 0.03
USP9810XAB75 4.3750 % VTRCOM 4 3/8 04/15/29 REGS	1'156 USD 46.33%	489'595.70 0.09
USU63768AB83 6.6250 % MRFGBZ 6 5/8 08/06/29 REGS	500 USD 89.78%	410'343.65 0.07
USV3856JAA17 5.5000 % GRNKEN 5 1/2 04/06/25 REGS	2'400 USD 94.83%	2'080'466.45 0.36
XS1720690889 4.0000 % MATTER 4 11/15/27 REGS	100 EUR 92.41%	90'059.37 0.02
XS1732478000 4.0000 % OSPRAQ 4 03/08/26 EMTN	1'100 GBP 92.78%	1'156'289.67 0.20
XS1843461689 5.0000 % KOANO 5 07/15/25 REGS	800 EUR 95.25%	540'113.63 0.09
XS1849558900 6.2500 % LHMCFI 6 1/4 12/20/23 REGS	600 EUR 100.04%	141'166.76 0.02

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.05.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2056371334	2.8750 % TELEFO 2 7/8 PERP	3'500	EUR	85.67%	2'922'141.87	0.51
XS2059777594	7.2500 % LHMCFI 7 1/4 10/02/25 REGS	1'300	EUR	97.02%	1'229'139.97	0.21
XS2102493389	3.0000 % ALTICE 3 01/15/28 REGS	680	EUR	76.78%	508'835.38	0.09
XS2111946930	3.1250 % ADRBID 3 1/8 02/15/26 REGS	1'900	EUR	87.75%	1'624'876.28	0.28
XS2195511006	6.0000 % AMSSW 6 07/31/25 REGS	2'050	EUR	87.31%	1'744'245.47	0.30
XS2198191962	6.6250 % THYELE 6 5/8 07/15/28 REGS	3'000	EUR	82.85%	2'180'098.64	0.38
XS2202907510	3.3750 % SPMIM 3 3/8 07/15/26 EMTN	200	EUR	93.82%	182'876.78	0.03
XS2205083749	3.8750 % AVTR 3 7/8 07/15/28 REGS	1'500	EUR	92.07%	1'345'934.82	0.23
XS2232108568	5.8750 % MAXDIY 5 7/8 10/01/26 REGS	2'000	EUR	72.24%	1'407'985.91	0.24
XS2291928849	3.7500 % STYRO 3 3/4 07/15/26 REGS	1'800	EUR	88.06%	1'544'829.69	0.27
XS2294854745	5.3750 % THOEUR 5 3/8 03/01/26 REGS	1'100	EUR	94.76%	1'015'899.38	0.18
XS2307567086	3.6250 % VCPLN 3 5/8 08/24/26	1'800	EUR	81.72%	1'433'541.18	0.25
XS2310951103	3.6250 % SAPSJ 3 5/8 03/15/28 REGS	1'500	EUR	88.91%	1'299'783.88	0.23
XS2319950130	3.6250 % AHLMUN 3 5/8 02/04/28 REGS	1'500	EUR	84.27%	1'231'836.62	0.21
XS2342247355	6.5000 % TUICRU 6 1/2 05/15/26 REGS	3'300	EUR	91.61%	2'946'133.92	0.51
XS2348767836	2.5000 % SNSPW 2 1/2 06/07/28 REGS	350	EUR	79.36%	270'680.50	0.05
XS2355632584	3.5000 % ATLNSA 3 1/2 04/30/28 REGS	1'500	EUR	72.90%	1'065'725.43	0.19
XS2370618618	6.5000 % SHODFP 6 1/2 08/01/26 REGS	4'000	GBP	76.59%	3'470'915.21	0.60
XS2397198487	5.1250 % LORCAT 5 1/8 09/30/29 REGS	800	EUR	87.14%	679'418.11	0.12
XS2401886788	4.5000 % LOXAM 4 1/2 02/15/27 REGS	2'950	EUR	95.08%	2'733'427.40	0.48
XS2486825669	4.2500 % VOV CAB 4 1/4 05/31/28 EMTN	2'150	EUR	94.37%	1'977'365.90	0.34
XS2498543102	7.5580 % GAMHOL 7.558 07/15/27 REGS	1'000	EUR	91.94%	896'032.68	0.16
XS2541618299	9.0000 % HOUSEH 9 11/03/29 REGS	1'000	EUR	96.73%	942'656.28	0.16
XS2558411224	13.2500 % NEMEAN 13 1/4 12/15/26 REGS	1'000	GBP	99.79%	1'130'606.89	0.20
XS2566291865	9.2500 % INTRUM 9 1/4 03/15/28 REGS	3'000	EUR	90.54%	2'647'107.47	0.46
XS2587558474	6.6250 % INEGRP 6 5/8 05/15/28 REGS	1'700	EUR	99.21%	1'643'653.39	0.29
XS26245454320	6.2500 % OI 6 1/4 05/15/28 REGS	1'200	EUR	102.35%	1'196'924.47	0.21

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.97457356
GBP	1 = CHF	1.13299751
USD	1 = CHF	0.91415000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	21'850'761.40	32.487
Bond	CHF	43'405'625.70	64.534
Equity	CHF	2'003'819.98	2.979
Total	CHF	67'260'207.08	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	7'006'979.28	1.219
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	569'657'584.06	99.121

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.06.2022 - 31.05.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
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	61'777'823.30
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: 01.06.2022 - 31.05.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.650	1.100	0.470	0.180	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

Periode: 01.06.2022 - 22.12.2022

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
GT CHF	0.550	0.900	0.370	0.180	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

Dieses Teilvermögen 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 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 19.09.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.09.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	5.479	1.917	3.562
NT CHF	Ja	CHF	5.695	1.993	3.702

## 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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (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 Ziffer 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen 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 Anteilsklasse 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 Anteilsklasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit der jeweiligen Anteilsklasse 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 Anhang (Ziff. 7.5) 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 Anhang zum Fondsvertrag genannt ist, veröffentlicht und der Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

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

## **Mitteilung an die Anleger**

des

### **Swisscanto (CH) Pension Bond Fund**

ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger  
(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

**Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Domestic CHF**

**Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Foreign CHF**

**Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD**

**Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Global High Yield**

(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.

Im Fondsvertrag werden neue Anteilsklassen eingefügt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

## **1. Neue Anteilsklassen**

### **1.1 Überblick über die neuen Anteilsklassen**

Bei allen Teilvermögen des Umbrella-Fonds werden folgende Anteilsklassen neu geschaffen:

- DTH1 CHF, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD;
- DAH1 CHF, DAH1 EUR, DAH1 GBP, DAH1 USD;
- GTH1 CHF, GTH1 EUR, GTH1 GBP, GTH1 USD;
- GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD;
- NTH1 CHF, NTH1 EUR, NTH1 GBP, NTH1 USD;
- NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP, NAH1 USD;
- STH1 CHF, STH1 EUR, STH1 GBP, STH1 USD;
- SAH1 CHF, SAH1 EUR, SAH1 GBP, SAH1 USD.

Zu den Eigenschaften der neuen Anteilsklassen siehe die Ausführungen unter Ziff. 1.2 nachstehend.

## **1.2 Eigenschaften der neuen Anteilsklassen**

### **1.2.1 Anteilsklassen DTH1 CHF, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD, DAH1 CHF, DAH1 EUR, DAH1 GBP, DAH1 USD**

Die Anteilsklassen stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) sowie Anlegern offen, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Die Anteilsklassen stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Treasorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteilsklassen ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Die Anteilsklassen können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden. (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Es wird eine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Fondsvermögens in der in Ziff. 1.3 dieser Veröffentlichung aufgeführten Maximalhöhe erhoben (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "T" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge thesauriert (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 3 des angepassten Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "A" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge ausgeschüttet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 2 des angepassten Fondsvertrages).

Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "CHF" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Schweizer Franken (CHF) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "EUR" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Euro (EUR) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "GBP" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Pfund Sterling (GBP) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "USD" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung US-Dollar (USD) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen erfolgt eine systematische Währungsabsicherung (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Das heisst, dass Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung einer Anteilsklasse und den Anlagewährungen des jeweiligen Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

### **1.2.2 Anteilsklassen GTH1 CHF, GTH1 EUR, GTH1 GBP, GTH1 USD, GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD**

Die Anteilsklassen stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) offen, sofern diese einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Investitionsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Die Anteilsklassen stehen den

vor erwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteilsklassen ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Weitere Voraussetzung ist, dass der Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG eine Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen hat (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Es wird eine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Fondsvermögens in der in Ziff. 1.3 dieser Veröffentlichung aufgeführten Maximalhöhe erhoben (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "T" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge thesauriert (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 3 des angepassten Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "A" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge ausgeschüttet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 2 des angepassten Fondsvertrages).

Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "CHF" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Schweizer Franken (CHF) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "EUR" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Euro (EUR) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "GBP" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Pfund Sterling (GBP) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "USD" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung US-Dollar (USD) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen erfolgt eine systematische Währungsabsicherung (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Das heisst, dass Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung einer Anteilsklasse und den Anlagewährungen des jeweiligen Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

### **1.2.3 Anteilsklassen NTH1 CHF, NTH1 EUR, NTH1 GBP, NTH1 USD, NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP, NAH1 USD**

Die Anteilsklassen werden nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) angeboten, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Dienstleistungsvertrag (Vermögensverwaltungsvertrag, Beratungsvertrag, Investitionsvertrag oder ein anderer Dienstleistungsvertrag) mit einem entsprechenden Kooperationspartner der Swisscanto Fondsleitung AG oder einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit der Zürcher Kantonalbank einen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag abgeschlossen haben (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Die Anteilsklassen stehen den vor erwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen und keinen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben, stehen die Anteilsklassen nicht zu Verfügung. Banken können die Anteile nur anbieten, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht. (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Die Fondsleitung wird für die Fondsverwaltung (d.h. die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank) nicht über die pauschale Verwaltungskommission, sondern über eine Vergütung entschädigt, die im Rahmen der oben genannten Verträge zwischen dem Anleger auf der einen Seite und der Zürcher Kantonalbank oder einem Kooperationspartner der Zürcher Kantonalbank, der Swisscanto Fondsleitung AG oder einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe oder einer Bank auf der anderen Seite festgelegt wird (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Es wird keine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Fondsvermögens erhoben (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages sowie § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "T" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge thesauriert (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 3 des angepassten Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "A" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge ausgeschüttet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 2 des angepassten Fondsvertrages).

Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "CHF" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Schweizer Franken (CHF) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "EUR" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Euro (EUR) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "GBP" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Pfund Sterling (GBP) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "USD" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung US-Dollar (USD) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen erfolgt eine systematische Währungsabsicherung (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Das heisst, dass Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung einer Anteilsklasse und den Anlagewährungen des jeweiligen Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

#### **1.2.4 Anteilsklassen STH1 CHF, STH1 EUR, STH1 GBP, STH1 USD, SAH1 CHF, SAH1 EUR, SAH1 GBP, SAH1 USD**

Die Anteilsklassen werden in der entsprechenden Währung (Rechnungseinheit) erstmalig zu 100'000 ausgegeben (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen stehen nur der Swisscanto Fondsleitung AG oder anderen Fondsleitungen, die einen Kooperationsvertrag mit der Swisscanto Fondsleitung AG abgeschlossen haben, offen. Die Entschädigung der Fondsleitung und ihrer Beauftragten für die Leitung, das Asset Management und gegebenenfalls die Vertriebstätigkeit wird nicht dem Fondsvermögen belastet, sondern auf der Grundlage einer individuellen Vereinbarung beziehungsweise Regelung separat vergütet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Dem Fondsvermögen wird keine pauschale Verwaltungskommission belastet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages sowie § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "T" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge thesauriert (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 3 des angepassten Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen mit dem Buchstaben "A" als zweiter Buchstabe in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse werden die Erträge ausgeschüttet (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages i.V.m. § 22 Ziff. 2 des angepassten Fondsvertrages).

Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "CHF" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Schweizer Franken (CHF) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "EUR" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als

Referenzwährung Euro (EUR) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "GBP" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung Pfund Sterling (GBP) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Die Anteilsklassen mit den Buchstaben "USD" als drei letzte Buchstaben in der Bezeichnung der jeweiligen Anteilsklasse weisen als Referenzwährung US-Dollar (USD) auf (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages).

Bei den Anteilsklassen erfolgt eine systematische Währungsabsicherung (vgl. § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages). Das heisst, dass Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung einer Anteilsklasse und den Anlagewährungen des jeweiligen Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

### **1.3 Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen**

Gemäss § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages stellt die Fondsleitung für die Leitung, die Vermögensverwaltung und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit in Bezug auf den Umbrella-Fonds bzw. die Teilvermögen und alle Aufgaben der Depotbank wie die Aufbewahrung des Fondsvermögens, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen in § 4 des Fondsvertrages aufgeführten Aufgaben zulasten der Teilvermögen eine jährliche maximale Pauschalkommission in Prozenten des der jeweiligen Anteilsklasse zugeordneten Teils des Nettofondsvermögens des jeweiligen Teilvermögens gemäss der nachfolgenden Aufstellung in Rechnung, die pro rata temporis bei jeder Berechnung des Bewertungs-Nettoinventarwertes dem Vermögen des entsprechenden Teilvermögens belastet und jeweils am Monatsende ausbezahlt wird (pauschale Verwaltungskommission; sofern entschädigt inkl. Vertriebskommission):

#### **Teilvermögen Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Domestic CHF, Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Foreign CHF, Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD**

- Anteilsklassen DTH1 CHF, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD, DAH1 CHF, DAH1 EUR, DAH1 GBP, DAH1 USD: höchstens 0.70% p.a.
- Anteilsklassen GTH1 CHF, GTH1 EUR, GTH1 GBP, GTH1 USD, GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD: höchstens 0.60% p.a.
- Anteilsklassen NTH1 CHF, NTH1 EUR, NTH1 GBP, NTH1 USD, NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP, NAH1 USD, STH1 CHF, STH1 EUR, STH1 GBP, STH1 USD, SAH1 CHF, SAH1 EUR, SAH1 GBP, SAH1 USD: 0%. Die Entschädigung der Fondsleitung für die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank, erfolgt im Rahmen der in § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages genannten vertraglichen Vereinbarungen bzw. Regelungen.

#### **Teilvermögen Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Global High Yield**

- Anteilsklassen DTH1 CHF, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD, DAH1 CHF, DAH1 EUR, DAH1 GBP, DAH1 USD: höchstens 1.10% p.a.
- Anteilsklassen GTH1 CHF, GTH1 EUR, GTH1 GBP, GTH1 USD, GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD: höchstens 0.90% p.a.
- Anteilsklassen NTH1 CHF, NTH1 EUR, NTH1 GBP, NTH1 USD, NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP, NAH1 USD, STH1 CHF, STH1 EUR, STH1 GBP, STH1 USD, SAH1 CHF, SAH1 EUR, SAH1 GBP, SAH1 USD: 0%. Die Entschädigung der Fondsleitung für die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank, erfolgt im Rahmen der in § 6 Ziff. 4.3 des Fondsvertrages genannten vertraglichen Vereinbarungen bzw. Regelungen.

Der effektiv angewandte Satz der pauschalen Verwaltungskommission ist jeweils aus dem Jahresbericht ersichtlich (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

## **2. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift**

§ 15 Ziff. 3 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben."

## **3. Keine Regelung der Umwandlung mehr**

Bisher wurde in § 24 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 24 des Fondsvertrages und in § 24 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 und Ziff. 2 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

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

Die Aufnahme neuer Anteilsklassen stellt allerdings keine Änderung des Fondsvertrages im Sinne von Art. 27 KAG dar. Gegen die in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen besteht somit kein Einwendungsrecht.

Ebenfalls kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 2 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Fondsvertrag mit Anhang, der Jahresbericht sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Juni 2022

### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Pension Bond Fund

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Domestic CHF

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Foreign CHF

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Global High Yield

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Die Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 2 A Bst. aa, § 8 Ziff. 2 B Bst. aa, § 8 Ziff. 2 C Bst. aa sowie § 8 Ziff. 2 D Bst. aa des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Domestic CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (auf Schweizer Franken lautende Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Wandelobligationen, Wandelnotes, Bail-in Bonds und Optionsanleihen, sowie Geldmarktinstrumente) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldern mit Domizil in der Schweiz aus dem Rating-Bereich von Aaa bis Baa3 (Moody's) resp. AAA bis BBB- (Standard & Poor's), wobei bei Fehlen eines offiziellen Ratings ein Bankenrating oder implizites Rating herangezogen werden kann, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 A Bst. aa des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Foreign CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (auf Schweizer Franken lautende Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Wandelobligationen, Wandelnotes, Bail-in Bonds und Optionsanleihen, sowie Geldmarktinstrumente) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldern mit Domizil in- und ausserhalb der Schweiz aus dem Rating-Bereich von Aaa bis Baa3 (Moody's) resp. AAA bis BBB- (Standard & Poor's), wobei bei Fehlen eines offiziellen Ratings ein Bankenrating oder implizites Rating herangezogen werden kann, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 B Bst. aa des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (auf den US-Dollar (USD) oder andere Währungen aus dem Dollarraum (Kanada, Australien, Neuseeland, Singapur und Hongkong) lautende Obligationen, Notes sowie fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Wandelobligationen, Wandelnotes, Bail-in Bonds und Optionsanleihen, sowie Geldmarktinstrumente (von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldern aus dem Rating-Bereich von Aaa bis Ba3 (Moody's) resp. AAA bis BB- (Standard & Poor's), wobei bei Fehlen eines offiziellen Ratings auch ein Bankenrating oder implizites Rating herangezogen werden kann, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 C Bst. aa des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Global High Yield ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (auf frei konvertierbare Währung lautende Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswert-papiere und -rechte, einschliesslich Wandelobligationen, Wandelnotes, Bail-in Bonds und Optionsanleihen, sowie Geldmarktinstrumente) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldner überwiegend aus dem Rating-Bereich von Ba1 bis Caa3 (Moody's) resp. BB+ bis CCC- (Standard & Poor's), wobei bei Fehlen eines offiziellen Ratings auch ein Bankenrating oder implizites Rating bei herangezogen werden kann, zu den zulässigen Anlagen gehören. Zudem gilt, dass Währungsrisiken aus Anlagen, welche nicht auf die Rechnungseinheit des Teilvermögens (Schweizer Franken) lauten, gegenüber dem Schweizer Franken abgesichert werden können (vgl. § 8 Ziff. 2 D Bst. aa des Fondsvertrages).

\* \* \*

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

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

Der Fondsvertrag mit Anhang, der Jahresbericht sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. April 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich