

SWISSCANTO (CH) PENSION BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL HIGH YIELD

Jahresbericht per 31.05.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	3095586	CHF
GT CHF	19225188	CHF
NT CHF	19225187	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. September 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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 Global High Yield

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

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegeführten 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 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	16
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	16
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
8	Pauschale Verwaltungskommission	17
9	Benchmark	18
10	TER	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.06.2023	01.06.2022	01.06.2021	01.06.2020
	bis	31.05.2024	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		526'702'338.43	574'708'607.03	602'367'798.44	610'805'900.21
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'105'760.03	1'039'362.39	1'433'414.31	1'570'170.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'450.000	9'450.000	12'685.000	12'685.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		117.0116	109.9854	113.0007	123.7800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		117.0116	109.9854	113.2606	123.7800
Thesaurierung je Anteil		6.59	5.47	5.14	4.85
Total Expense Ratio (TER)		0.65 %	0.65 %	0.65 %	0.65 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode				11'395'089.66	19'930'718.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				113'775.000	181'790.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				100.1546	109.6400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP				100.3850	109.6400
Thesaurierung je Anteil				4.66	4.40
Total Expense Ratio (TER)				0.55 %	0.55 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		525'596'578.40	573'669'244.64	589'539'294.47	589'305'010.60
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'844'550.925	5'649'990.925	5'673'939.205	5'200'498.101
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		108.4923	101.5345	103.9030	113.3200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		108.4923	101.5345	104.1420	113.3200
Thesaurierung je Anteil		6.77	5.69	5.43	5.14
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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	8.23 %	10.02 %	-11.70 %	3.75 %
Klasse GT CHF (Schliessung 22.12.2022)	-	-	-11.45 %	3.85 %
Klasse NT CHF	8.94 %	10.73 %	-11.13 %	4.42 %

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)	31.05.2024	31.05.2023
Bankguthaben auf Sicht	8'527'043.71	25'145'997.61
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	503'860'320.47	542'862'534.26
Derivative Finanzinstrumente	5'836'441.47	-2'383'580.83
Sonstige Vermögenswerte	8'479'141.26	9'084'266.89
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	526'702'946.91	574'709'217.93
Andere Verbindlichkeiten	-608.48	-610.90
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	526'702'338.43	574'708'607.03

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'450.000	12'685.000
Zurückgenommene Anteile		-	-3'235.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'450.000	9'450.000

Klasse GT CHF	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	113'775.000
Zurückgenommene Anteile		-	-113'775.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-

Klasse NT CHF	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'649'990.925	5'673'939.205
Ausgegebene Anteile		11'933.000	2'495.000
Zurückgenommene Anteile		-817'373.000	-26'443.280
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'844'550.925	5'649'990.925

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		574'708'607.03	602'367'798.44
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-11'268'563.91	-10'809'407.76
Saldo aus dem Anteilverkehr		-82'682'092.13	-13'379'466.21
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		45'944'387.44	-3'470'317.44
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		526'702'338.43	574'708'607.03

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		720'981.22	121'039.56
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-9'618.66
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		34'697'384.90	31'677'903.33
Erträge aus Wertpapierleihe		470'814.85	545'137.00
Sonstige Erträge		0.00	0.13
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		32'307.50	8'370.85
Total Ertrag		35'921'488.47	32'342'832.21
Aufwand			
Passivzinsen		-58.49	-761.52
Reglementarische Vergütungen		-6'966.87	-13'064.97
Sonstige Aufwendungen		-2.26	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-3'006'111.57	-98'486.74
Total Aufwand		-3'013'139.19	-112'313.23
Nettoertrag / Verlust			
		32'908'349.28	32'230'518.98
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-61'213'323.29	-415'451.35
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		288'652.18	38'561.40
Realisierter Erfolg		-28'016'321.83	31'853'629.03
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		73'960'709.27	-35'323'946.47
Gesamterfolg		45'944'387.44	-3'470'317.44

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.05.2024	31.05.2023
Nettoertrag	62'312.13	51'785.58
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	62'312.13	51'785.58
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	21'809.25	18'124.95
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	40'502.88	33'660.63
Total	62'312.13	51'785.58
Klasse NT CHF		
Nettoertrag	32'846'037.15	32'178'733.40
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	32'846'037.15	32'178'733.40
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	11'496'113.00	11'262'556.69
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	21'349'924.15	20'916'176.71
Total	32'846'037.15	32'178'733.40

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							503'860'320.47	95.66	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							503'860'320.47	95.66	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1282945554	5.2500 % MATTER 5 1/4 07/31/28	0	4'500	0	4'500 CHF	103.50%	4'657'500.00	0.88	a)
XS2333565815	3.6250 % DUFNSW 3 5/8 04/15/26	4'850	0	4'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CHF							4'657'500.00	0.88	
BE6342263157	5.7500 % AZELIS 5 3/4 03/15/28 REGS	1'450	0	450	1'000 EUR	102.69%	1'005'699.17	0.19	a)
FR0013534336	3.3750 % EDF 3 3/8 PERP	3'600	0	600	3'000 EUR	88.53%	2'601'118.37	0.49	a)
FR0014006G24	1.0000 % ATOFP 1 11/12/29	1'200	1'800	0	3'000 EUR	23.79%	698'890.80	0.13	a)
FR001400EFQ6	7.5000 % EDF 7 1/2 PERP EMTN	3'000	0	600	2'400 EUR	109.42%	2'571'960.46	0.49	a)
FR001400EJ15	5.3750 % ILDFP 5 3/8 06/14/27	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FV85	5.6250 % ILDFP 5 5/8 02/15/30	3'500	0	500	3'000 EUR	102.65%	3'015'834.13	0.57	a)
FR001400MLX3	5.3750 % ILDFP 5 3/8 02/15/29	0	3'200	500	2'700 EUR	102.12%	2'700'235.88	0.51	a)
FR001400OLD1	4.8750 % OPMFP 4 7/8 03/13/29 EMTN	0	3'400	0	3'400 EUR	99.90%	3'326'373.91	0.63	a)
FR001400PIA0	5.8750 % ELOFR 5 7/8 04/17/28 EMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	99.61%	2'243'796.85	0.43	a)
FR001400PRQ7	5.3750 % ILDFP 5 3/8 05/02/31	0	3'100	0	3'100 EUR	100.68%	3'056'824.83	0.58	a)
NO0012826033	10.6870 % SKIBID FLOAT 03/02/28	3'750	0	0	3'750 EUR	104.42%	3'835'055.67	0.73	a)
PTEDPLOM0017	1.7000 % EDPLP 1.7 07/20/2080	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTEDPROM0029	1.8750 % EDPLP 1 7/8 08/02/2081	2'600	0	500	2'100 EUR	94.26%	1'938'630.89	0.37	a)
SE0016278352	6.7500 % HEIMST 6 3/4 PERP	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0161100515	7.7500 % TITIM 7 3/4 01/24/33 EMTN	1'050	0	1'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1496337236	4.1250 % CAR 4 1/8 11/15/24 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1645722262	1.8750 % ATLM 1 7/8 07/13/27 EMTN	3'000	0	1'100	1'900 EUR	93.25%	1'735'186.59	0.33	a)
XS1647815775	4.8750 % ADRBID 4 7/8 07/01/24 REGS	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1685702794	5.2500 % INLOTG 5 1/4 09/15/24 REGS	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1711584430	2.6250 % SPMIM 2 5/8 01/07/25 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1716927766	5.1050 % FERSM 5.105 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1720690889	4.0000 % MATTER 4 11/15/27 REGS	1'450	0	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1789515134	3.8750 % BDC 3 7/8 03/15/28 REGS	1'200	0	100	1'100 EUR	97.67%	1'052'241.94	0.20	a)
XS1794209459	4.0000 % PAPREC 4 03/31/25 REGS	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1795406658	3.8750 % TELEFO 3 7/8 PERP	1'300	0	100	1'200 EUR	98.13%	1'153'259.44	0.22	a)
XS1812087598	3.3750 % ATLNSA 3 3/8 04/30/26 REGS	0	1'250	0	1'250 EUR	93.61%	1'145'928.33	0.22	a)
XS1820759147	5.1250 % ATALIA 5 1/8 05/15/25 REGS	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1827600724	4.0000 % CC 4 05/15/26	1'550	0	1'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843461689	5.0000 % KOANO 5 07/15/25 REGS	1'750	0	750	1'000 EUR	98.68%	702'869.73	0.13	a)
XS1844997970	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	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1849558900	6.2500 % LHMCFI 6 1/4 12/20/23 REGS	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1881594946	6.7500 % ROSINI 6 3/4 10/30/25 REGS	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1933828433	4.3750 % TELEFO 4 3/8 PERP	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1963830002	3.1250 % EOPF 3 1/8 06/15/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2009038113	3.5000 % IGT 3 1/2 06/15/26 REGS	2'312	0	2'312	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010025836	7.2500 % STENA 7 1/4 02/15/28 REGS	2'600	0	500	2'100 EUR	105.20%	2'163'591.05	0.41	a)
XS2010030596	10.1250 % CCL 10 1/8 02/01/26 REGS	1'950	0	1'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010032618	2.6240 % SBBSS 2.624 PERP	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010034077	3.3750 % KILOTO 3 3/8 12/15/26 REGS	1'500	0	150	1'350 EUR	97.04%	1'283'005.38	0.24	a)
XS2010039894	3.0000 % ZFFNGR 3 10/23/29	4'000	0	500	3'500 EUR	92.04%	3'154'919.87	0.60	a)
XS2010039977	2.5000 % ZFFNGR 2 1/2 10/23/27	1'000	0	100	900 EUR	93.39%	823'182.13	0.16	a)
XS2031871069	3.7500 % LOXAM 3 3/4 07/15/26	3'000	0	2'000	1'000 EUR	98.92%	968'786.58	0.18	a)
XS2034068432	3.7500 % TRIVIU 3 3/4 08/15/26 REGS	2'400	700	2'000	1'100 EUR	98.06%	1'056'411.14	0.20	a)
XS2036387525	2.1250 % ARGID 2 1/8 08/15/26 REGS	750	0	0	750 EUR	81.04%	595'248.59	0.11	a)
XS2051904733	2.3750 % IGT 2 3/8 04/15/28 REGS	2'700	0	500	2'200 EUR	93.77%	2'020'324.36	0.38	a)
XS2052290439	3.1250 % MATTER 3 1/8 09/15/26 REGS	1'550	0	1'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2053846262	3.3750 % SFRFP 3 3/8 01/15/28 REGS	300	0	0	300 EUR	68.65%	201'687.30	0.04	a)
XS2055106210	3.3750 % ARNDTN 3 3/8 PERP	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2056371334	2.8750 % TELEFO 2 7/8 PERP	4'300	0	1'500	2'800 EUR	94.24%	2'584'402.42	0.49	a)
XS2056730323	2.8750 % IFXGR 2 7/8 PERP EMTN	2'900	0	1'500	1'400 EUR	98.54%	1'351'077.23	0.26	a)
XS2059777594	7.2500 % LHMCFI 7 1/4 10/02/25 REGS	0	4'591	0	4'591 EUR	99.98%	2'718'902.49	0.52	a)
XS2059777594	7.2500 % LHMCFI 7 1/4 10/02/25 REGS	5'341	0	5'341	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2067263850	5.7500 % KANGRP 5 3/4 10/31/26 REGS	1'500	0	150	1'350 EUR	99.00%	1'308'932.83	0.25	a)
XS2078976805	2.1250 % PPFTEL 2 1/8 01/31/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079413527	4.4960 % CITCON 4.496 PERP	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2081474046	2.3750 % EOPF 2 3/8 06/15/27	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2102493389	3.0000 % ALTICE 3 01/15/28 REGS	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2110077299	2.2490 % AKFAST 2.249 05/17/2081	0	1'000	0	1'000 EUR	91.67%	897'772.20	0.17	a)
XS2110768525	3.7500 % STENA 3 3/4 02/01/25 REGS	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2111946930	3.1250 % ADRBID 3 1/8 02/15/26 REGS	2'550	0	500	2'050 EUR	97.28%	1'953'166.26	0.37	a)
XS2111947748	3.6250 % ADRBID 3 5/8 02/15/28 REGS	2'000	0	400	1'600 EUR	94.67%	1'483'508.13	0.28	a)
XS2113253210	3.8750 % SAZKAG 3 7/8 02/15/27 REGS	3'500	0	500	3'000 EUR	97.69%	2'870'132.71	0.54	a)
XS2116386132	3.3750 % ZIGGO 3 3/8 02/28/30 REGS	2'650	0	500	2'150 EUR	83.64%	1'761'210.50	0.33	a)
XS2125121769	3.3750 % HEIBOS 3 3/8 PERP	0	3'500	0	3'500 EUR	66.45%	2'277'778.17	0.43	a)
XS2138128314	8.0000 % SFRFP 8 05/15/27 REGS	2'800	1'000	3'000	800 EUR	31.91%	250'045.84	0.05	a)
XS2154325489	3.3750 % SYNNVX 3 3/8 04/16/26 EMTN	2'050	0	2'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2171875839	2.7500 % CPIPGR 2 3/4 05/12/26 EMTN	0	1'625	0	1'625 EUR	92.07%	1'465'229.84	0.28	a)
XS2189356996	2.1250 % ARGID 2 1/8 08/15/26 REGS	2'500	0	1'500	1'000 EUR	81.06%	793'919.42	0.15	a)
XS2195511006	6.0000 % AMSSW 6 07/31/25 REGS	2'350	0	2'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2198191962	6.6250 % THYELE 6 5/8 07/15/28 REGS	3'000	1'500	500	4'000 EUR	96.22%	3'392'577.61	0.64	a)
XS2198388592	9.2500 % PRFINE 9 1/4 07/15/25 REGS	7'200	0	7'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2202907510	3.3750 % SPMIM 3 3/8 07/15/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2205083749	3.8750 % AVTR 3 7/8 07/15/28 REGS	1'500	0	150	1'350 EUR	97.44%	1'288'267.56	0.24	a)
XS2229875989	3.2500 % F 3 1/4 09/15/25 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2231191748	4.8750 % CPIPGR 4 7/8 PERP	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2231331260	3.7500 % ZFFNGR 3 3/4 09/21/28 EMTN	2'400	0	1'400	1'000 EUR	96.27%	942'833.18	0.18	a)
XS2232102876	4.1250 % SFRFP 4 1/8 01/15/29 REGS	0	2'500	0	2'500 EUR	66.50%	1'628'282.08	0.31	a)
XS2232108568	5.8750 % MAXDIY 5 7/8 10/01/26 REGS	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2240463674	4.0000 % LORCAT 4 09/18/27 REGS	2'000	0	400	1'600 EUR	97.72%	1'531'191.88	0.29	a)
XS2240978085	2.5000 % VOVCAB 2 1/2 10/07/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2247614063	2.6250 % DRXLN 2 5/8 11/01/25	1'800	0	400	1'400 EUR	97.01%	1'330'126.47	0.25	a)
XS2247623643	3.5000 % GETFP 3 1/2 10/30/25	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2249892535	2.6250 % ADEBNO 2 5/8 11/15/25 REGS	3'250	0	3'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2249894234	3.0000 % ADEBNO 3 11/15/27 REGS	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2251742537	2.6250 % AVTR 2 5/8 11/01/25 REGS	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2256949749	3.2480 % ABESM 3.248 PERP	2'700	0	1'000	1'700 EUR	97.26%	1'619'365.86	0.31	a)
XS2264155305	7.6250 % CCL 7 5/8 03/01/26 REGS	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2265369657	3.0000 % LHAGR 3 05/29/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2271332285	0.7500 % SBBSS 0 3/4 12/14/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	63.61%	1'245'998.28	0.24	a)
XS2272845798	2.8750 % ZIGGO 2 7/8 01/15/29 REGS	3'600	0	500	3'100 EUR	86.71%	2'632'687.50	0.50	a)
XS2275090749	3.7500 % IMAIM 3 3/4 01/15/28 REGS	2'300	0	500	1'800 EUR	94.87%	1'672'454.77	0.32	a)
XS2282606578	2.6250 % ABESM 2 5/8 PERP	4'200	0	2'500	1'700 EUR	93.79%	1'561'592.61	0.30	a)
XS2287912450	5.2500 % VERISR 5 1/4 02/15/29 REGS	2'000	0	400	1'600 EUR	97.15%	1'522'322.67	0.29	a)
XS2288109676	1.6250 % TITIM 1 5/8 01/18/29 EMTN	1'500	0	1'054	446 EUR	85.41%	373'084.52	0.07	a)
XS2291911282	7.2500 % MANTEN 7 1/4 02/01/26 REGS	3'000	800	500	3'300 EUR	93.81%	3'031'843.95	0.58	a)
XS2291928849	3.7500 % STYRO 3 3/4 07/15/26 REGS	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2291929573	2.5000 % STYRO 2 1/2 01/15/26 REGS	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2294854745	5.3750 % THOEUR 5 3/8 03/01/26 REGS	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2298381307	4.2500 % KPERST 4 1/4 03/01/26 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	83.99%	1'233'893.22	0.23	a)
XS2298382453	6.5000 % KPERST 6 1/2 09/01/26 REGS	4'250	0	3'250	1'000 EUR	49.12%	481'068.32	0.09	a)
XS2301390089	1.8750 % ATLIM 1 7/8 02/12/28	1'500	0	150	1'350 EUR	91.27%	1'206'717.08	0.23	a)
XS2305744059	2.2500 % IQV 2 1/4 03/15/29 REGS	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2307567086	3.6250 % VCPLN 3 5/8 08/24/26	1'850	0	1'850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2310487074	2.0000 % AMPBEV 2 09/01/28 REGS	2'100	200	500	1'800 EUR	87.79%	1'547'590.51	0.29	a)
XS2310511717	3.0000 % AMPBEV 3 09/01/29 REGS	1'650	200	1'850	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2310951103	3.6250 % SAPSJ 3 5/8 03/15/28 REGS	2'000	0	400	1'600 EUR	95.45%	1'495'715.05	0.28	a)
XS2319950130	3.6250 % AHLMMUN 3 5/8 02/04/28 REGS	1'500	0	150	1'350 EUR	93.38%	1'234'680.64	0.23	a)
XS2326493728	3.3750 % HNDLIN 3 3/8 04/15/29 REGS	2'000	0	400	1'600 EUR	94.60%	1'482'332.89	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2331728126	3.7500 % TIFSLN 3 3/4 04/15/29 REGS	2'800	0	1'400	1'400 EUR	92.78%	1'272'114.26	0.24	a)
XS2332975007	4.0000 % SFRFP 4 07/15/29 REGS	400	0	0	400 EUR	66.55%	260'697.50	0.05	a)
XS2336345140	5.5000 % CBRSER 5 1/2 04/15/26 REGS	3'400	0	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2338564870	2.0000 % ZFFNGR 2 05/06/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342057143	3.6250 % UNSEAM 3 5/8 06/01/28 REGS	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342247355	6.5000 % TUICRU 6 1/2 05/15/26 REGS	0	4'450	0	4'450 EUR	101.42%	3'997'891.74	0.76	a)
XS2342247355	6.5000 % TUICRU 6 1/2 05/15/26 REGS	4'200	750	4'950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346224806	1.1250 % SBBBSS 1 1/8 11/26/29 EMTN	0	6'000	0	6'000 EUR	62.07%	3'647'441.96	0.69	a)
XS2347397437	3.6250 % CITCON 3 5/8 PERP	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348767836	2.5000 % SNSPW 2 1/2 06/07/28 REGS	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2349786835	3.5000 % PAPREC 3 1/2 07/01/28 REGS	2'700	0	2'000	700 EUR	95.48%	654'574.15	0.12	a)
XS2355632584	3.5000 % ATLNSA 3 1/2 04/30/28 REGS	1'500	4'000	1'750	3'750 EUR	75.79%	2'783'649.13	0.53	a)
XS2357281174	4.0000 % NHHSM 4 07/02/26 REGS	1'500	0	150	1'350 EUR	99.34%	1'313'375.27	0.25	a)
XS2388186996	4.5000 % LHMCFI 4 1/2 03/15/27 REGS	4'700	0	2'000	2'700 EUR	98.41%	2'602'184.91	0.49	a)
XS2389112736	4.6250 % ITLYUM 4 5/8 10/01/26 REGS	1'500	1'500	500	2'500 EUR	97.73%	2'392'952.51	0.45	a)
XS2394823418	4.8750 % EOLOSP 4 7/8 10/21/28 REGS	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2397198487	5.1250 % LORCAT 5 1/8 09/30/29 REGS	4'300	0	500	3'800 EUR	96.44%	3'589'092.84	0.68	a)
XS2397251807	3.6250 % HEIBOS 3 5/8 PERP EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	66.52%	1'302'880.30	0.25	a)
XS2397354528	4.6250 % GRAANU 4 5/8 10/15/26 REGS	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2397447025	4.7500 % MODULA 4 3/4 11/30/28 REGS	4'300	0	500	3'800 EUR	92.87%	3'456'268.23	0.66	a)
XS2397448346	6.7500 % MODULA 6 3/4 11/30/29 REGS	4'000	0	500	3'500 EUR	81.14%	2'781'151.72	0.53	a)
XS2397781357	5.1250 % ILDFP 5 1/8 10/15/26 REGS	2'700	0	2'296	404 EUR	100.06%	395'916.21	0.08	a)
XS2397781944	5.6250 % ILDFP 5 5/8 10/15/28 REGS	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2399700959	5.2500 % AGKLN 5 1/4 10/15/26 REGS	3'700	0	500	3'200 EUR	100.45%	3'147'973.17	0.60	a)
XS2401886788	4.5000 % LOXAM 4 1/2 02/15/27 REGS	2'950	0	500	2'450 EUR	99.65%	2'391'019.23	0.45	a)
XS2406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	1'000	0	250	750 EUR	97.06%	712'905.64	0.14	a)
XS2406607171	4.3750 % TEVA 4 3/8 05/09/30	6'450	0	600	5'850 EUR	96.52%	5'530'069.33	1.05	a)
XS2423013742	5.5000 % EDRSM 5 1/2 07/15/27 REGS	4'500	0	750	3'750 EUR	99.24%	3'644'849.07	0.69	a)
XS2431015655	3.5000 % ZIGGO 3 1/2 01/15/32 REGS	4'100	0	500	3'600 EUR	87.71%	3'092'254.65	0.59	a)
XS2434783911	5.2500 % ADRBID 5 1/4 02/01/30 REGS	2'850	0	500	2'350 EUR	99.20%	2'283'184.81	0.43	a)
XS2437324333	3.8750 % IPGIM 3 7/8 07/28/26	4'100	0	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	1'400	400	400	1'400 EUR	104.90%	1'438'349.22	0.27	a)
XS2486825669	4.2500 % VOVCAB 4 1/4 05/31/28 EMTN	2'450	0	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2498543102	7.5580 % GAMHOL 7.558 07/15/27 REGS	3'550	1'700	500	4'750 EUR	99.02%	4'606'248.72	0.87	a)
XS2536848448	9.7500 % GAMENT 9 3/4 09/30/27 REGS	2'200	200	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2541618299	9.0000 % HOUSEH 9 11/03/29 REGS	3'400	0	500	2'900 EUR	104.94%	2'980'374.93	0.57	a)
XS2548508881	11.0000 % FEDRIG 11 10/25/27 REGS	5'600	0	5'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2550380104	10.3750 % LHMCFI 10 3/8 11/30/27 REGS	0	3'150	0	3'150 EUR	107.31%	2'979'599.16	0.57	a)
XS2550380104	10.3750 % LHMCFI 10 3/8 11/30/27 REGS	3'400	250	3'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2553825949	7.2500 % EOFP 7 1/4 06/15/26	3'550	0	500	3'050 EUR	104.64%	3'125'600.85	0.59	a)
XS2566291865	9.2500 % INTRUM 9 1/4 03/15/28 REGS	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2581393134	6.8750 % TITIM 6 7/8 02/15/28	5'200	0	4'084	1'116 EUR	104.23%	1'139'257.76	0.22	a)
XS2581396079	9.5750 % LIMACO FLOAT 02/01/28 REGS	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2582788100	10.0000 % FIREBC 10 02/06/28 REGS	2'500	1'000	500	3'000 EUR	106.92%	3'141'526.94	0.60	a)
XS2586123965	4.8670 % F 4.867 08/03/27	4'700	0	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2587558474	6.6250 % INEGRP 6 5/8 05/15/28 REGS	1'700	0	200	1'500 EUR	103.43%	1'519'507.95	0.29	a)
XS2615006470	8.7500 % CABBCO 8 3/4 05/01/28 REGS	3'000	0	500	2'500 EUR	102.99%	2'521'691.17	0.48	a)
XS2615562274	6.7500 % GRUPHA 6 3/4 05/15/30 REGS	2'900	0	500	2'400 EUR	105.09%	2'470'019.42	0.47	a)
XS2615937187	7.2500 % SAZKAG 7 1/4 04/30/30 REGS	2'500	0	500	2'000 EUR	105.42%	2'064'950.49	0.39	a)
XS2619047728	9.3750 % BENTLR 9 3/8 05/15/28 REGS	2'400	3'700	600	5'500 EUR	106.51%	5'737'273.44	1.09	a)
XS2623489627	8.5000 % DAN 8 1/2 07/15/31 REGS	3'800	0	500	3'300 EUR	108.76%	3'514'920.96	0.67	a)
XS2623496085	6.1250 % F 6 1/8 05/15/28	3'800	0	3'000	800 EUR	106.44%	833'940.55	0.16	a)
XS2623604233	9.5000 % PELHOL 9 1/2 04/01/27 REGS	5'200	450	500	5'150 EUR	101.09%	5'098'902.54	0.97	a)
XS2624554320	6.2500 % OI 6 1/4 05/15/28 REGS	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2637954582	7.8750 % TITIM 7 7/8 07/31/28	0	1'500	1'090	410 EUR	108.12%	434'132.42	0.08	a)
XS2643284388	7.2500 % PEPGRP 7 1/4 07/01/28 REGS	0	3'000	500	2'500 EUR	103.79%	2'541'327.61	0.48	a)
XS2646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	0	2'700	500	2'200 EUR	107.55%	2'317'274.35	0.44	a)
XS2647351142	10.2500 % AMARAZ 10 1/4 07/15/28 REGS	0	6'700	3'800	2'900 EUR	94.58%	2'686'273.93	0.51	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2649695736	7.8750 % LHMCFI 7 7/8 07/31/28 REGS	0	4'000	500	3'500 EUR	106.04%	3'634'847.22	0.69	a)
XS2649707846	9.3750 % PRFINE 9 3/8 07/15/28 REGS	0	9'150	3'600	5'550 EUR	98.99%	5'380'787.81	1.02	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	0	3'700	500	3'200 EUR	105.79%	3'315'391.21	0.63	a)
XS2681940297	7.0000 % IPGIM 7 09/27/28	0	3'000	500	2'500 EUR	107.75%	2'638'261.11	0.50	a)
XS2708134023	7.8620 % VARNO 7.862 11/15/2083	0	3'900	500	3'400 EUR	108.19%	3'602'653.25	0.68	a)
XS2711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	0	1'200	100	1'100 EUR	107.26%	1'155'502.20	0.22	a)
XS2712525109	7.2500 % PAPREC 7 1/4 11/17/29 REGS	0	3'100	500	2'600 EUR	105.40%	2'683'926.37	0.51	a)
XS2719090636	8.5000 % STYRO 8 1/2 03/15/29 REGS	0	3'500	500	3'000 EUR	105.77%	3'107'650.40	0.59	a)
XS2719293826	10.0000 % INTDGP 10 11/15/28 REGS	0	4'700	450	4'250 EUR	104.10%	4'333'118.56	0.82	a)
XS2719998952	11.0000 % EGBLFN 11 11/30/28 REGS	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2732357525	6.3750 % LOXAM 6 3/8 05/31/29 REGS	0	3'100	500	2'600 EUR	104.01%	2'648'455.41	0.50	a)
XS2739001019	11.5000 % SFRFP 11 1/2 02/01/27	0	2'000	0	2'000 EUR	79.36%	1'554'403.03	0.30	a)
XS2750308483	4.7500 % ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN	0	2'900	0	2'900 EUR	101.19%	2'874'066.86	0.55	a)
XS2758100296	10.0000 % ADRBID 10 02/15/29 REGS	0	927	0	927 EUR	101.44%	920'800.39	0.17	a)
XS2760863329	6.5000 % LHMCFI 6 1/2 03/15/29 REGS	0	4'200	0	4'200 EUR	103.04%	4'238'580.12	0.80	a)
XS2761223127	6.7500 % THOEUR 6 3/4 02/01/30 REGS	0	3'750	0	3'750 EUR	102.55%	3'766'120.01	0.72	a)
XS2774392638	5.5000 % EOPF 5 1/2 06/15/31	0	4'600	0	4'600 EUR	102.34%	4'610'628.48	0.88	a)
XS2776523669	5.8750 % TUIGR 5 7/8 03/15/29 REGS	0	4'200	0	4'200 EUR	100.65%	4'140'270.60	0.79	a)
XS2778270772	6.0000 % FNACFP 6 04/01/29	0	700	0	700 EUR	103.67%	710'721.64	0.13	a)
XS2792575453	6.3750 % CBRSER 6 3/8 04/15/30 REGS	0	2'300	0	2'300 EUR	100.56%	2'265'263.74	0.43	a)
XS2798880493	7.7500 % TITIM 7 3/4 01/24/33	0	950	0	950 EUR	117.39%	1'092'155.83	0.21	a)
XS2798883752	6.8750 % TITIM 6 7/8 02/15/28	0	1'584	0	1'584 EUR	106.04%	1'645'028.00	0.31	a)
XS2798884057	7.8750 % TITIM 7 7/8 07/31/28	0	590	0	590 EUR	110.07%	636'029.51	0.12	a)
XS2798884131	1.6250 % TITIM 1 5/8 01/18/29	0	904	0	904 EUR	87.49%	774'613.70	0.15	a)
XS2810807094	6.8750 % ILDFP 6 7/8 04/15/31 REGS	0	2'800	0	2'800 EUR	101.81%	2'791'798.50	0.53	a)
XS2810867742	6.5000 % MAHLGR 6 1/2 05/02/31 REGS	0	2'100	0	2'100 EUR	100.53%	2'067'626.14	0.39	a)
XS2821788770	10.0000 % FEDRIG 10 06/15/29 REGS	0	3'000	0	3'000 EUR	100.35%	2'948'374.87	0.56	a)
EUR							271'162'462.08	51.48	
FR0011401728	6.0000 % EDF 6 PERP EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	98.25%	1'692'774.86	0.32	a)
FR0011700293	5.8750 % EDF 5 7/8 PERP EMTN	3'500	0	0	3'500 GBP	95.79%	3'850'912.06	0.73	a)
XS1713495759	3.8750 % IRM 3 7/8 11/15/25 REGS	1'200	0	0	1'200 GBP	97.46%	1'343'317.21	0.26	a)
XS1732478000	4.0000 % OSPRAQ 4 03/08/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	94.65%	1'413'241.60	0.27	a)
XS1820760079	6.6250 % ATALIA 6 5/8 05/15/25 REGS	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1996438948	5.2500 % VMED 5 1/4 05/15/29 REGS	1'500	0	0	1'500 GBP	89.99%	1'550'495.63	0.29	a)
XS2052466815	3.2500 % PINEFI 3 1/4 09/30/25 REGS	1'200	0	1'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2187646901	4.8750 % VMED 4 7/8 07/15/28 REGS	3'000	0	1'500	1'500 GBP	88.75%	1'529'010.74	0.29	a)
XS2199627030	3.6250 % BMELN 3 5/8 07/15/25	2'050	0	2'050	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2230739059	6.5000 % CPKLN 6 1/2 08/28/26	2'650	350	0	3'000 GBP	98.77%	3'403'571.53	0.65	a)
XS2258560361	4.6250 % THAMES 4 5/8 05/19/26 REGS	1'850	0	1'850	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2303071992	3.2500 % ASSDLN 3 1/4 02/16/26 REGS	2'550	1'100	3'650	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2329602135	4.3750 % GTWICK 4 3/8 04/07/26	3'400	0	0	3'400 GBP	96.83%	3'781'305.85	0.72	a)
XS2358483258	4.5000 % VMED 4 1/2 07/15/31 REGS	1'600	0	0	1'600 GBP	82.69%	1'519'629.98	0.29	a)
XS2364423652	6.7500 % PIZEXP 6 3/4 07/15/26 REGS	600	0	600	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2370618618	6.5000 % SHODFP 6 1/2 08/01/26 REGS	4'050	750	500	4'300 GBP	83.55%	4'126'333.28	0.78	a)
XS2411236859	3.6250 % PINEFI 3 5/8 11/15/27 REGS	1'350	0	1'350	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2558411224	13.2500 % NEMEAN 13 1/4 12/15/26 REGS	4'745	0	0	4'745 GBP	107.55%	5'861'406.26	1.11	a)
XS2615792194	10.2500 % TRAVEL 10 1/4 04/28/28 REGS	2'800	0	0	2'800 GBP	104.56%	3'362'816.29	0.64	a)
XS2636324274	8.3750 % BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN	0	2'900	0	2'900 GBP	106.15%	3'535'746.38	0.67	a)
XS2660424008	10.8750 % ICELTD 10 7/8 12/15/27 REGS	0	2'250	0	2'250 GBP	104.09%	2'690'142.31	0.51	a)
XS2696093033	10.0000 % PURGYM 10 10/11/28 REGS	0	4'300	0	4'300 GBP	106.07%	5'238'904.75	0.99	a)
XS2782148261	6.6250 % HTHROW 6 5/8 03/01/31	0	1'500	0	1'500 GBP	98.32%	1'694'049.83	0.32	a)
XS2783792307	6.0000 % PINEFI 6 03/27/30 REGS	0	2'100	0	2'100 GBP	98.29%	2'370'873.77	0.45	a)
XS2811958839	8.1250 % ASSDLN 8 1/8 05/14/30 REGS	0	4'700	0	4'700 GBP	99.77%	5'386'085.13	1.02	a)
GBP							54'350'617.46	10.32	
BE6300372289	5.5000 % TNETBB 5 1/2 03/01/28 144A	4'200	0	0	4'200 USD	94.61%	3'584'877.06	0.68	a)
US00253XAA90	5.5000 % AAL 5 1/2 04/20/26 144A	2'900	0	250	2'650 USD	99.05%	1'578'625.37	0.30	a)
US013822AH42	7.1250 % AA 7 1/8 03/15/31 144A	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US019576AC18	6.0000 % UNSEAM 6 06/01/29 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02154CAH60	5.7500 % ALTICE 5 3/4 08/15/29 144A	0	1'750	0	1'750 USD	74.24%	1'172'041.70	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US02156LAA98	8.1250 % SFRFP 8 1/8 02/01/27 144A	2'750	1'400	250	3'900 USD	76.98%	2'708'523.14	0.51	a)
US02156TAA25	6.0000 % SFRFP 6 02/15/28 144A	3'000	1'500	1'000	3'500 USD	31.16%	984'011.09	0.19	a)
US02156TAB08	10.5000 % SFRFP 10 1/2 05/15/27 144A	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0237715586	11.7500 % AAL 11 3/4 07/15/25 144A	4'650	0	4'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023771T329	7.2500 % AAL 7 1/4 02/15/28 144A	250	0	0	250 USD	99.85%	225'199.19	0.04	a)
US023771T402	8.5000 % AAL 8 1/2 05/15/29 144A	0	2'700	0	2'700 USD	103.11%	2'511'534.18	0.48	a)
US03674XAN66	8.3750 % AR 8 3/8 07/15/26 144A	1'523	0	0	1'523 USD	103.65%	1'424'069.56	0.27	a)
US03674XAS53	5.3750 % AR 5 3/8 03/01/30 144A	1'000	0	0	1'000 USD	95.73%	863'628.20	0.16	a)
US037411BF15	4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	2'000	0	200	1'800 USD	92.58%	1'503'378.85	0.29	a)
US045054AF03	4.3750 % AHTLN 4 3/8 08/15/27 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04625HAJ86	10.0000 % ASTONM 10 03/31/29 144A	0	3'900	0	3'900 USD	96.64%	3'399'991.34	0.65	a)
US053773BC09	5.7500 % CAR 5 3/4 07/15/27 144A	2'000	0	0	2'000 USD	95.83%	1'729'042.65	0.33	a)
US058498AW66	2.8750 % BALL 2 7/8 08/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	84.48%	2'286'463.09	0.43	a)
US071734AC18	5.7500 % BHCCN 5 3/4 08/15/27 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US100018AA89	10.0000 % BORRO 10 11/15/28 144A	0	1'250	0	1'250 USD	105.04%	1'139'052.47	0.22	a)
US100018AB62	10.3750 % BORRNO 10 3/8 11/15/30 144A	0	2'250	0	2'250 USD	104.23%	2'061'859.22	0.39	a)
US1248EPBT92	5.1250 % CHTR 5 1/8 05/01/27 144A	1'500	0	0	1'500 USD	95.51%	1'292'438.13	0.25	a)
US1248EPCD32	4.7500 % CHTR 4 3/4 03/01/30 144A	0	500	0	500 USD	85.16%	384'117.43	0.07	a)
US1248EPCQ45	4.7500 % CHTR 4 3/4 02/01/32 144A	1'000	0	0	1'000 USD	80.51%	726'357.05	0.14	a)
US12543DBC39	8.0000 % CYH 8 03/15/26 144A	2'500	0	1'265	1'235 USD	100.00%	1'114'155.25	0.21	a)
US12543DBK54	4.7500 % CYH 4 3/4 02/15/31 144A	1'500	0	0	1'500 USD	79.00%	1'069'020.69	0.20	a)
US12543DBN93	10.8750 % CYH 10 7/8 01/15/32 144A	0	2'000	0	2'000 USD	103.36%	1'864'960.57	0.35	a)
US126307AH04	5.2500 % CSCHLD 5 1/4 06/01/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126307BM89	11.2500 % CSCHLD 11 1/4 05/15/28 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14366RAA77	10.3750 % CCL 10 3/8 05/01/28 144A	500	0	0	500 USD	108.31%	488'550.31	0.09	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	1'500	0	0	1'500 USD	94.13%	1'273'831.29	0.24	a)
US161175BL78	5.3750 % CHTR 5 3/8 05/01/47	1'000	0	0	1'000 USD	80.22%	723'722.77	0.14	a)
US16411QAG64	4.5000 % CQP 4 1/2 10/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	95.07%	857'701.07	0.16	a)
US17302WAB46	9.2500 % CITHOL 9 1/4 08/01/24 144A	2'900	0	2'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US17302XAN66	8.3750 % CITPET 8 3/8 01/15/29 144A	0	1'000	0	1'000 USD	103.50%	933'725.25	0.18	a)
US20338QAA13	8.2500 % COMM 8 1/4 03/01/27 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20338QAD51	6.0000 % COMM 6 03/01/26 144A	2'750	0	0	2'750 USD	89.27%	2'214'611.35	0.42	a)
US20903XAF06	6.5000 % CNSL 6 1/2 10/01/28 144A	3'252	0	0	3'252 USD	84.50%	2'479'054.07	0.47	a)
US23585WAA27	8.5000 % DAC 8 1/2 03/01/28 144A	1'400	0	0	1'400 USD	102.13%	1'289'924.74	0.24	a)
US24703TAD81	6.0200 % DELL 6.02 06/15/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25461LAB80	8.8750 % DTV 8 7/8 02/01/30 144A	0	2'000	0	2'000 USD	96.33%	1'738'136.32	0.33	a)
US25470XAW56	5.8750 % DISH 5 7/8 11/15/24	600	300	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470XBB01	7.3750 % DISH 7 3/8 07/01/28	3'500	0	1'500	2'000 USD	45.04%	812'584.55	0.15	a)
US25470XBE40	5.2500 % DISH 5 1/4 12/01/26 144A	3'000	450	1'000	2'450 USD	79.62%	1'759'792.88	0.33	a)
US26151AAA79	6.6250 % DRXLN 6 5/8 11/01/25 144A	3'250	0	3'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US268317AM62	5.6250 % EDF 5 5/8 PERP 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26884LAG41	7.0000 % EQT 7 02/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	105.80%	954'438.61	0.18	a)
US26884LAH24	6.1250 % EQT 6 1/8 02/01/25	1'950	0	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AP43	4.6250 % ECOPEP 4 5/8 11/02/31	1'000	0	0	1'000 USD	81.19%	732'455.59	0.14	a)
US279158AS81	8.8750 % ECOPEP 8 7/8 01/13/33	3'600	0	400	3'200 USD	102.72%	2'965'518.61	0.56	a)
US279158AT64	8.6250 % ECOPEP 8 5/8 01/19/29	0	4'400	1'350	3'050 USD	104.47%	2'874'469.57	0.55	a)
US28228PAA93	6.7500 % EGBLFN 6 3/4 02/07/25 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30015DAA90	9.7500 % EVRGRN 9 3/4 04/26/28 144A	1'600	1'000	405	2'195 USD	106.05%	2'100'081.92	0.40	a)
US30251GBE61	6.1250 % FMGAU 6 1/8 04/15/32 144A	2'000	0	0	2'000 USD	97.77%	1'764'082.15	0.33	a)
US335934AU96	8.6250 % FMCN 8 5/8 06/01/31 144A	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345370CS72	5.2910 % F 5.291 12/08/46	3'250	0	0	3'250 USD	86.90%	2'547'779.86	0.48	a)
US345370DB39	6.1000 % F 6.1 08/19/32	500	0	0	500 USD	99.65%	449'496.24	0.09	a)
US345397A456	4.2710 % F 4.271 01/09/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345397C270	4.9500 % F 4.95 05/28/27	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US345397C353	7.3500 % F 7.35 11/04/27	2'800	0	500	2'300 USD	104.15%	2'161'138.22	0.41	a)
US345397C684	7.3500 % F 7.35 03/06/30	500	0	0	500 USD	105.35%	475'221.04	0.09	a)
US35906ABG22	6.7500 % FYBR 6 3/4 05/01/29 144A	2'000	0	0	2'000 USD	91.22%	1'645'936.59	0.31	a)
US361841AP42	4.0000 % GLPI 4 01/15/30	2'300	0	0	2'300 USD	90.66%	1'881'103.64	0.36	a)
US41984LAA52	5.7500 % HA 5 3/4 01/20/26 144A	0	3'500	0	3'500 USD	92.28%	2'913'606.19	0.55	a)
US44963BAD01	6.3750 % IHOVER 6 3/8 05/15/29 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.26%	886'416.50	0.17	a)
US449691AA27	6.5000 % ILDFP 6 1/2 10/15/26 144A	1'500	0	776	724 USD	99.52%	650'027.98	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	1'250	0	0	1'250 USD	87.38%	985'407.17	0.19	a)
US50077LBJ44	5.5000 % KHC 5 1/2 06/01/50	1'000	0	0	1'000 USD	95.82%	864'431.11	0.16	a)
US501797AN49	5.2500 % BBWI 5 1/4 02/01/28	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US527298BN21	4.6250 % LVL 4 5/8 09/15/27 144A	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55616XAJ63	4.3000 % M 4.3 02/15/43	3'000	0	0	3'000 USD	76.60%	2'073'194.83	0.39	a)
US57763RAC16	9.2500 % BWY 9 1/4 04/15/27 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US599191AA16	6.5000 % UAL 6 1/2 06/20/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	100.10%	586'995.63	0.11	a)
US603051AC70	8.0000 % MINAU 8 11/01/27 144A	1'800	0	0	1'800 USD	101.70%	1'651'443.31	0.31	a)
US629571AA86	7.2500 % NBR 7 1/4 01/15/26 144A	3'950	0	400	3'550 USD	100.29%	3'211'824.06	0.61	a)
US644393AB64	6.5000 % NFE 6 1/2 09/30/26 144A	1'750	0	0	1'750 USD	94.13%	1'486'025.99	0.28	a)
US66977WAQ24	4.8750 % NCX 4 7/8 06/01/24 144A	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US674599CF00	4.6250 % OXY 4 5/8 06/15/45	700	0	0	700 USD	79.35%	501'105.53	0.10	a)
US674599CJ22	4.4000 % OXY 4.4 04/15/46	1'200	0	0	1'200 USD	79.13%	856'656.38	0.16	a)
US674599CM50	3.0000 % OXY 3 02/15/27	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US674599CW33	2.9000 % OXY 2.9 08/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US674599DK85	4.5000 % OXY 4 1/2 07/15/44	1'340	0	0	1'340 USD	77.31%	934'622.17	0.18	a)
US674599EB77	5.8750 % OXY 5 7/8 09/01/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US674599EC50	6.3750 % OXY 6 3/8 09/01/28	1'250	0	0	1'250 USD	102.95%	1'160'943.00	0.22	a)
US71647NBD03	6.9000 % PETBRA 6.9 03/19/49	3'900	0	0	3'900 USD	93.82%	3'300'878.44	0.63	a)
US71647NBJ72	5.5000 % PETBRA 5 1/2 06/10/51	1'500	0	0	1'500 USD	78.34%	1'060'075.87	0.20	a)
US740212AL91	7.1250 % PDCN 7 1/8 01/15/26 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74166MAB28	5.2500 % PRSESE 5 1/4 04/15/24 144A	379	0	379	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US75281ABJ79	8.2500 % RRC 8 1/4 01/15/29	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780153BG60	5.5000 % RCL 5 1/2 04/01/28 144A	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780153BK72	5.3750 % RCL 5 3/8 07/15/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	98.02%	884'251.34	0.17	a)
US780153BL55	11.6250 % RCL 11 5/8 08/15/27 144A	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78454LAN01	6.7500 % SM 6 3/4 09/15/26	3'000	0	300	2'700 USD	100.02%	2'436'316.52	0.46	a)
US80627DAC02	4.7500 % IHOVER 4 3/4 09/15/26 144A	2'700	0	250	2'450 USD	96.83%	2'140'246.23	0.41	a)
US830867AA59	4.5000 % DAL 4 1/2 10/20/25 144A	696	0	696	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US85207UAH86	7.1250 % S 7 1/8 06/15/24	2'500	0	250	2'250 USD	100.02%	2'030'141.98	0.39	a)
US85207UAK16	7.6250 % S 7 5/8 03/01/26	2'000	0	200	1'800 USD	102.78%	1'669'062.30	0.32	a)
US855170AA41	9.0000 % SYNH 9 10/01/30 144A	0	4'000	0	4'000 USD	104.38%	3'766'476.25	0.72	a)
US85858EAB92	6.1250 % STENA 6 1/8 02/01/25 144A	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GCZ19	4.8750 % THC 4 7/8 01/01/26	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GDB32	5.1250 % THC 5 1/8 11/01/27	850	0	0	850 USD	97.43%	747'127.70	0.14	a)
US88033GDK31	6.1250 % THC 6 1/8 10/01/28	1'500	0	0	1'500 USD	99.14%	1'341'560.20	0.25	a)
US88033GDP28	6.1250 % THC 6 1/8 06/15/30 144A	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88033GDQ01	6.1250 % THC 6 1/8 06/15/30	0	2'400	200	2'200 USD	99.27%	1'970'281.17	0.37	a)
US88167AAK79	6.7500 % TEVA 6 3/4 03/01/28	500	0	0	500 USD	101.97%	459'961.18	0.09	a)
US88167AAN19	7.1250 % TEVA 7 1/8 01/31/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US896522AJ82	7.7500 % TRN 7 3/4 07/15/28 144A	0	1'700	0	1'700 USD	103.04%	1'580'216.77	0.30	a)
US89686QAB23	8.5000 % TRIVIU 8 1/2 08/15/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.61%	898'640.64	0.17	a)
US90320BAA70	4.8750 % UPCB 4 7/8 07/15/31 144A	3'000	0	0	3'000 USD	89.25%	2'415'452.50	0.46	a)
US910047AH22	5.0000 % UAL 5 02/01/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91327TAA97	10.5000 % UNIT 10 1/2 02/15/28 144A	1'500	0	0	1'500 USD	100.04%	1'353'739.23	0.26	a)
US92339LAA08	10.5000 % VRTV 10 1/2 11/30/30 144A	0	5'200	0	5'200 USD	105.45%	4'946'990.05	0.94	a)
US92769XAP06	5.5000 % VMED 5 1/2 05/15/29 144A	3'800	0	400	3'400 USD	90.61%	2'779'258.92	0.53	a)
US92857WBQ24	7.0000 % VOD 7 04/04/2079	2'000	0	0	2'000 USD	103.04%	1'859'078.55	0.35	a)
US92857WBW91	4.1250 % VOD 4 1/8 06/04/2081	0	1'500	0	1'500 USD	84.95%	1'149'537.57	0.22	a)
US92857WBX74	5.1250 % VOD 5 1/8 06/04/2081	3'850	0	0	3'850 USD	73.86%	2'565'466.96	0.49	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	2'750	0	2'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98877DAE58	7.1250 % ZFFNGR 7 1/8 04/14/30 144A	700	0	0	700 USD	103.16%	651'460.56	0.12	a)
USA35155AA77	5.7500 % KLAB 5 3/4 04/03/29 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	98.81%	1'337'135.15	0.25	a)
USF2941JAA81	9.1250 % EDF 9 1/8 PERP REGS	0	500	0	500 USD	110.16%	496'895.20	0.09	a)
USG05891AH20	10.5000 % ASTONM 10 1/2 11/30/25 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG4289TAA19	5.5000 % HBRLN 5 1/2 10/15/26 REGS	6'000	0	500	5'500 USD	98.17%	4'871'023.60	0.92	a)
USG4923NAB40	6.2500 % CMIENE 6 1/4 04/26/29 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG49774AB18	9.0000 % IAECN 9 07/15/26 REGS	6'200	750	0	6'950 USD	101.34%	6'354'022.43	1.21	a)
USG5002FAU06	5.8750 % TTMTIN 5 7/8 01/15/28 REGS	2'750	0	250	2'500 USD	97.28%	2'194'051.35	0.42	a)
USG53431AA32	6.7500 % LILAPR 6 3/4 10/15/27 REGS	1'575	0	1'575	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG53901AA58	10.8750 % LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS	4'500	0	0	4'500 USD	105.18%	4'269'966.17	0.81	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USG64252AA01	6.6250 % NEPENE 6 5/8 05/15/25 REGS	4'850	0	4'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG91237AB60	10.2500 % TLWLN 10 1/4 05/15/26 REGS	4'059	0	266	3'793 USD	96.71%	3'308'876.83	0.63	a)
USG9444PAG75	7.7500 % VMED 7 3/4 04/15/32 REGS	0	300	0	300 USD	97.42%	263'651.53	0.05	a)
USJ64264AK09	9.7500 % RAKUTN 9 3/4 04/15/29 REGS	0	800	0	800 USD	100.77%	727'255.59	0.14	a)
USL56608AP43	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	89.94%	1'620'028.88	0.31	a)
USL62788AE12	7.2500 % STENA 7 1/4 01/15/31 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	101.75%	2'753'731.68	0.52	a)
USL6364EAA12	4.8750 % EKT 4 7/8 01/15/28 REGS	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USL6401PAJ23	4.3750 % BEEFBZ 4 3/8 03/18/31 REGS	200	0	0	200 USD	82.47%	148'798.82	0.03	a)
USL6401PAM51	8.8750 % BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 REGS	0	3'400	0	3'400 USD	104.28%	3'198'468.18	0.61	a)
USL65266AA36	5.2500 % MOVIBZ 5 1/4 02/08/31 REGS	3'250	0	250	3'000 USD	80.88%	2'188'922.63	0.42	a)
USL65266AC91	7.8500 % MOVIBZ 7.85 04/11/29 REGS	0	6'000	4'000	2'000 USD	93.20%	1'681'571.51	0.32	a)
USP1905CAJ91	5.7500 % BRFSBZ 5 3/4 09/21/50 REGS	200	400	0	600 USD	78.43%	424'517.51	0.08	a)
USP4955MAA91	5.7500 % GAXO 5 3/4 06/08/26 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	96.55%	1'045'230.99	0.20	a)
USP5865GAC44	7.5000 % INVTLA 7 1/2 05/19/26 REGS	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	1'850	300	0	2'150 USD	79.17%	1'535'560.34	0.29	a)
USP9810XAB75	4.3750 % VTRCOM 4 3/8 04/15/29 REGS	1'156	0	1'156	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	98.31%	1'951'088.83	0.37	a)
USV3856JAA17	5.5000 % GRNKEN 5 1/2 04/06/25 REGS	3'150	0	3'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1577965004	7.7500 % MHPSA 7 3/4 05/10/24 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2203824789	11.2500 % KAISAG 11 1/4 04/16/25	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2449192942	8.0000 % ZHPRHK 8 03/06/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2706258352	11.0000 % ENGPPO 11 11/02/28 REGS	0	5'000	1'000	4'000 USD	105.40%	3'803'320.06	0.72	a)

USD **173'689'740.93** **32.98**

Derivative Finanzinstrumente

5'836'441.47 **1.11**

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall	16.06.2023	3'000'000	2'907'858	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	16.06.2023	2'000'000	1'829'948	USD/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	16.06.2023	301'661'378	311'421'322	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	16.06.2023	211'820'423	231'695'494	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	16.06.2023	42'280'164	38'415'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	16.06.2023	1'500'000	1'469'013	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	16.06.2023	2'938'479	3'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	16.06.2023	2'930'697	3'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	16.06.2023	1'498'249	1'360'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	16.06.2023	2'432'820	2'500'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	16.06.2023	700'000	782'900	GBP/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	16.06.2023	1'000'000	1'027'435	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	31.08.2023	2'674'392	3'000'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	31.08.2023	7'759'392	8'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	31.08.2023	44'322'265	39'075'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	31.08.2023	307'742'619	316'448'757	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	31.08.2023	205'959'221	229'695'494	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	31.08.2023	1'800'000	1'610'842	USD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	31.08.2023	2'018'730	1'780'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	31.08.2023	1'300'000	1'471'257	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	31.08.2023	3'275'790	3'150'000	EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	31.08.2023	88'947	80'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	202'021'320	230'895'494	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	305'550'472	321'172'967	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	43'782'050	39'635'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'741'754	2'000'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	30.11.2023	2'244'100	2'150'000	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	2'401'078	2'500'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	30.11.2023	750'000	719'821	EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	1'106'320	1'000'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	30.11.2023	1'317'740	1'200'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	30.11.2023	1'317'740	1'200'000	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	30.11.2023	1'000'000	957'376	EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	441'576	400'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	30.11.2023	2'000'000	1'890'758	EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	947'509	875'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	961'720	1'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	4'818'230	5'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	EUR/CHF Verfall 30.11.2023		963'396	1'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 30.11.2023		1'100'963	1'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 30.11.2023		886'490	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		311'401'774	324'678'867		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 29.02.2024		201'789'163	231'260'014		CHF/USD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 29.02.2024		47'281'928	42'910'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		1'917'112	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.02.2024		700'000	610'131		USD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		4'696'295	5'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 29.02.2024		61'217'855	58'000'000		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.02.2024		17'000'000	14'611'619		USD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		3'789'860	4'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 29.02.2024		1'720'914	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		1'891'760	2'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 29.02.2024		1'719'898	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		189'178	200'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		472'960	500'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.02.2024		1'000'000	859'929		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 29.02.2024		2'140'168	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		3'286'175	3'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 29.02.2024		2'701'688	2'500'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		938'828	1'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.02.2024		1'100'000	935'484		USD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		933'211	1'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		6'500'000	6'899'333		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.02.2024		6'000'000	5'242'116		USD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 29.02.2024		2'853'507	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 12.03.2024		1'600'000	1'536'139		EUR/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 24.05.2024		277'701'205	292'560'345		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 24.05.2024		184'623'955	211'960'014		CHF/USD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 24.05.2024		50'221'916	45'410'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 24.05.2024		2'176'573	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 24.05.2024		3'320'363	3'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 24.05.2024		872'003	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 24.05.2024		1'528'670	1'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 24.05.2024		1'000'000	1'114'918		GBP/CHF	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 24.05.2024		2'365'245	2'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 24.05.2024		2'793'443	2'500'000		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 24.05.2024		9'319'179	8'400'000		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 24.05.2024		897'515	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 24.05.2024		1'000'000	1'132'372		GBP/CHF	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 24.05.2024		700'000	789'660		GBP/CHF	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 24.05.2024		2'155'432	1'900'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 24.05.2024		2'000'000	1'952'290		EUR/CHF	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 24.05.2024		2'964'474	3'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 23.08.2024		294'003'334	298'660'345		CHF/EUR	3'128'801.25	0.59	b)	
	USD/CHF Verfall 23.08.2024		184'999'373	204'347'393		CHF/USD	2'345'374.33	0.45	b)	
	GBP/CHF Verfall 23.08.2024		53'801'325	46'710'000		CHF/GBP	627'278.69	0.12	b)	
	CHF/GBP Verfall 23.08.2024		1'500'000	1'727'933		GBP/CHF	-20'351.68	0.00	b)	
	CHF/EUR Verfall 23.08.2024		17'000'000	16'733'066		EUR/CHF	-176'246.74	-0.03	b)	
	CHF/USD Verfall 23.08.2024		3'500'000	3'166'636		USD/CHF	-38'199.47	-0.01	b)	
	CHF/USD Verfall 23.08.2024		2'763'121	2'500'000		USD/CHF	-30'214.91	-0.01	b)	
Devisentermingeschäfte								5'836'441.47	1.11	

Kreditderivate

							Kurswert CHF	in % 7)
06/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/28	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00
06/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/28	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	8'527'043.71	1.62
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	503'860'320.47	95.66
Derivative Finanzinstrumente	5'836'441.47	1.11
Sonstige Vermögenswerte	8'479'141.26	1.61
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	526'702'946.91	100.00

Andere Verbindlichkeiten

-608.48

Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode**526'702'338.43**

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);	503'860'320.47	95.66
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	5'836'441.47	1.11
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten**81'663'530.75 15.50****Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte****81'663'530.75 15.50**

BE6342263157	5.7500 % AZELIS 5 3/4 03/15/28 REGS	1'000 EUR	102.69%	1'005'699.17	0.19
FR0014006G24	1.0000 % ATOFP 1 11/12/29	500 EUR	23.79%	116'481.80	0.02
NO0012826033	10.6870 % SKIBID FLOAT 03/02/28	3'500 EUR	104.42%	3'579'385.29	0.68
US053773BC09	5.7500 % CAR 5 3/4 07/15/27 144A	1'300 USD	95.83%	1'123'877.72	0.21
US12543DBN93	10.8750 % CYH 10 7/8 01/15/32 144A	1'805 USD	103.36%	1'683'126.91	0.32
US345370CS72	5.2910 % F 5.291 12/08/46	1'267 USD	86.90%	993'242.18	0.19
US345370DB39	6.1000 % F 6.1 08/19/32	500 USD	99.65%	449'496.24	0.09
US644393AB64	6.5000 % NFE 6 1/2 09/30/26 144A	1'500 USD	94.13%	1'273'736.56	0.24
US71647NBD03	6.9000 % PETBRA 6.9 03/19/49	2'000 USD	93.82%	1'692'758.17	0.32
US71647NB172	5.5000 % PETBRA 5 1/2 06/10/51	1'000 USD	78.34%	706'717.25	0.13
US91327TAA97	10.5000 % UNIT 10 1/2 02/15/28 144A	1'064 USD	100.04%	960'252.36	0.18
US92857WBQ24	7.0000 % VOD 7 04/04/2079	500 USD	103.04%	464'769.64	0.09
US92857WBW91	4.1250 % VOD 4 1/8 06/04/2081	1'200 USD	84.95%	919'630.06	0.17
USG49774AB18	9.0000 % IAECN 9 07/15/26 REGS	3'750 USD	101.34%	3'428'429.37	0.65
USJ64264AK09	9.7500 % RAKUTN 9 3/4 04/15/29 REGS	800 USD	100.77%	727'255.59	0.14
USL6401PAM51	8.8750 % BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 REGS	1'000 USD	104.28%	940'725.93	0.18
USL65266AC91	7.8500 % MOVIBZ 7.85 04/11/29 REGS	2'000 USD	93.20%	1'681'571.51	0.32
USP1905CAJ91	5.7500 % BRFSBZ 5 3/4 09/21/50 REGS	500 USD	78.43%	353'764.59	0.07
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	2'100 USD	79.17%	1'499'849.64	0.28
XS1812087598	3.3750 % ATLNSA 3 3/8 04/30/26 REGS	1'200 EUR	93.61%	1'100'091.20	0.21
XS2010039894	3.0000 % ZFNNGR 3 10/23/29	500 EUR	92.04%	450'702.84	0.09
XS2116386132	3.3750 % ZIGGO 3 3/8 02/28/30 REGS	2'000 EUR	83.64%	1'638'335.35	0.31
XS2198191962	6.6250 % THYELE 6 5/8 07/15/28 REGS	3'400 EUR	96.22%	2'883'690.97	0.55
XS2232102876	4.1250 % SFRFP 4 1/8 01/15/29 REGS	900 EUR	66.50%	586'181.55	0.11
XS2298381307	4.2500 % KPERST 4 1/4 03/01/26 REGS	1'500 EUR	83.99%	1'233'893.22	0.23
XS2298382453	6.5000 % KPERST 6 1/2 09/01/26 REGS	1'000 EUR	49.12%	481'068.32	0.09
XS2310487074	2.0000 % AMPBEV 2 09/01/28 REGS	1'000 EUR	87.79%	859'772.50	0.16
XS2310951103	3.6250 % SAPSJ 3 5/8 03/15/28 REGS	300 EUR	95.45%	280'446.57	0.05
XS2319950130	3.6250 % AHLMUN 3 5/8 02/04/28 REGS	1'300 EUR	93.38%	1'188'951.73	0.23
XS2346224806	1.1250 % SBBBSS 1 1/8 11/26/29 EMTN	1'900 EUR	62.07%	1'155'023.29	0.22
XS2355632584	3.5000 % ATLNSA 3 1/2 04/30/28 REGS	3'700 EUR	75.79%	2'746'533.81	0.52
XS2370618618	6.5000 % SHODFP 6 1/2 08/01/26 REGS	4'000 GBP	83.55%	3'838'449.56	0.73
XS2399700959	5.2500 % AGKLN 5 1/4 10/15/26 REGS	500 EUR	100.45%	491'870.81	0.09
XS2401886788	4.5000 % LOXAM 4 1/2 02/15/27 REGS	2'400 EUR	99.65%	2'342'222.92	0.44
XS2431015655	3.5000 % ZIGGO 3 1/2 01/15/32 REGS	600 EUR	87.71%	515'375.77	0.10
XS2434783911	5.2500 % ADRBID 5 1/4 02/01/30 REGS	2'350 EUR	99.20%	2'283'184.81	0.43
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	550 EUR	104.90%	565'065.76	0.11
XS2498543102	7.5580 % GAMHOL 7.558 07/15/27 REGS	4'750 EUR	99.02%	4'606'248.72	0.87
XS2587558474	6.6250 % INEGRP 6 5/8 05/15/28 REGS	1'500 EUR	103.43%	1'519'507.95	0.29
XS2615006470	8.7500 % CABBCO 8 3/4 05/01/28 REGS	2'500 EUR	102.99%	2'521'691.17	0.48
XS2619047728	9.3750 % BENTLR 9 3/8 05/15/28 REGS	2'100 EUR	106.51%	2'190'595.31	0.42
XS2623604233	9.5000 % PELHOL 9 1/2 04/01/27 REGS	2'100 EUR	101.09%	2'079'164.14	0.39
XS2647351142	10.2500 % AMARAZ 10 1/4 07/15/28 REGS	2'900 EUR	94.58%	2'686'273.93	0.51
XS2649695736	7.8750 % LHMCFI 7 7/8 07/31/28 REGS	600 EUR	106.04%	623'116.67	0.12
XS2649707846	9.3750 % PRFINE 9 3/8 07/15/28 REGS	1'100 EUR	98.99%	1'066'462.45	0.20
XS2660424008	10.8750 % ICELTD 10 7/8 12/15/27 REGS	2'200 GBP	104.09%	2'630'361.37	0.50
XS2696093033	10.0000 % PURGYM 10 10/11/28 REGS	4'250 GBP	106.07%	5'177'987.25	0.98
XS2708134023	7.8620 % VARN0 7.862 11/15/2083	2'000 EUR	108.19%	2'119'207.79	0.40

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.05.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2712525109	7.2500 % PAPREC 7 1/4 11/17/29 REGS	2'300 EUR	105.40%	2'374'242.56	0.45	
XS2732357525	6.3750 % LOXAM 6 3/8 05/31/29 REGS	500 EUR	104.01%	509'318.35	0.10	
XS2758100296	10.0000 % ADRBID 10 02/15/29 REGS	800 EUR	101.44%	794'757.77	0.15	
XS2760863329	6.5000 % LHMCFI 6 1/2 03/15/29 REGS	2'500 EUR	103.04%	2'522'964.36	0.48	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.97937361
GBP	1 = CHF	1.14861738
USD	1 = CHF	0.90215000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	33'742'752.80	38.038
Bond	CHF	54'188'163.77	61.085
Equity	CHF	778'196.33	0.877
Total	CHF	88'709'112.90	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	24'022'552.01	4.561
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	530'503'978.66	100.722

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.06.2023 - 31.05.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	81'663'530.75
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	Max
DT CHF	0.650	1.100	0.470	0.180	4.000	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000	4.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der 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 2023 / 2024

Ex-Datum: 17.09.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 20.09.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	6.593	2.307	4.286
NT CHF	Ja	CHF	6.779	2.372	4.407

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 Anteilklassen (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 Anteilklasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Anteilklasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit der jeweiligen Anteilklasse 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, marktkonforme 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 Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zu-zurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, 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 Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD

und des **Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate**

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, ein Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate (nachfolgend der/die "Umbrella-Fonds") zu vereinigen und die Fondsverträge der Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen beim Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund.

In Teil III dieser Veröffentlichung werden die zusätzlichen Anpassungen betreffend die Schaffung neuer Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert.

Im Übrigen werden einzelne Anpassungen der Fondsverträge formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF	16. Mai 2024

2 Gründe für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 24 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplante Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist beim übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 24 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum das übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile

der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate. Die Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)
DA USD	DA CHF
NT USD	NT CHF

Die Anleger erhalten somit nach dem Umtausch neu Anteile mit Währung CHF.

Am 17. Mai 2024 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate bzw. übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund aufgrund der Schlusskurse vom 16. Mai 2024 durchgeführt. Am 17. Mai 2024 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 16. Mai 2024 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 12. Januar 2024 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie den Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.swissfunddata.ch veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund und des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	14. Mai 2024
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	14. Mai 2024
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	15. bis 21. Mai 2024
Stichtag Vereinigung		16. Mai 2024

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene der an der Vereinigung beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens

Im Hinblick auf die Vereinigung muss der Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 24 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen für die Vereinigung in Einklang zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend);
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend);
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend);
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend); und
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigung und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens erhält die neue Überschrift "Zulässige Anlagen". Überdies lauten die Bestimmungen in § 8 Ziff. 1 Bst. d des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens betreffend zulässige Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen neu wie folgt:

"Anteile an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds), wenn (i) deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 10% begrenzen; (ii) für diese Zielfonds in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds und (iii) diese Zielfonds im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 19 Anteile von Zielfonds erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist."

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 2C Bst. a-c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird umfassend angepasst und lautet neu wie folgt:

- "a) Die Fondsleitung investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens des Teilvermögens in:
- aa) Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -wertrechte) von in- und ausländischen nicht staatlichen Emittenten (Nicht-Regierungs-Anleihen), welche bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF gegen die Risiken von

Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung (Schweizer Franken (CHF)) abgesichert sind;

- ab) Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen, die gemäss ihren Dokumenten ihr Vermögen gemäss den Richtlinien dieses Teilvermögens oder Teilen davon anlegen;
- ac) Derivate (einschliesslich Warrants) auf die oben erwähnten Anlagen;
- ad) strukturierte Produkte wie namentlich Zertifikate von Emittenten weltweit auf die oben erwähnten Anlagen.

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

- b) Die Fondsleitung kann zudem unter Vorbehalt von Bst. c höchstens ein Drittel des Fondsvermögens investieren in:
 - ba) Forderungswertpapiere und -rechte von in- und ausländischen Emittenten, die den in Ziff. 2 Bst. aa genannten Anforderungen nicht genügen;
 - bb) Wandelobligationen, Wandelnotes und Optionsanleihen in- und ausländischer Emittenten;
 - bc) Geldmarktinstrumente von in- und ausländischen Emittenten;
 - bd) Aktien und andere Beteiligungswertpapiere und -rechte von Unternehmen weltweit;
 - be) Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen, die den in Ziff. 2 Bst. ab genannten Anforderungen nicht genügen;
 - bf) Derivate (einschliesslich Warrants) auf die oben erwähnten Anlagen;
 - bg) strukturierte Produkte wie namentlich Zertifikate von Emittenten weltweit auf die oben erwähnten Anlagen;
 - bh) Bankguthaben bei in- und ausländischen Banken.
- c) Zusätzlich hat die Fondsleitung die nachstehenden Anlagebeschränkungen, die sich auf das Vermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten:
 - andere kollektive Kapitalanlagen insgesamt höchstens 10%
 - Wandelobligationen, Wandelnotes und Optionsanleihen höchstens 25%
 - Contingent Convertible Bonds höchstens 10%
 - Aktien und andere Beteiligungswertpapiere und -rechte sowie Derivate (einschliesslich Warrants) auf solche Anlagen insgesamt höchstens 10%."

Bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik stützt sich der Vermögensverwalter auf Daten von Drittanbietern, wobei gemäss § 8 Ziff. 2C Bst. d des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens nun eine Präzisierung erfolgt, dass je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel Daten von MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research beigezogen werden können. Im Umfang von höchstens 33% des Vermögens des Teilvermögens (nach Abzug der flüssigen Mittel in Form von Bankguthaben) behält sich der Vermögensverwalter bei indirekten Anlagen über kollektive Kapitalanlagen oder über engagementerhöhende Derivate vor, die Nachhaltigkeitspolitik nicht anzuwenden. Eine Ausnahme bilden engagementerhöhende Derivate, denen nebst Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen nun auch Beteiligungspapiere zugrunde liegen (vgl. § 8 Ziff. 2C Bst. d des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

2.2 Flüssige Mittel

In den Vorschriften über flüssige Mittel (vgl. § 9 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens) wird ergänzt, dass nebst Bankguthaben auch Forderungen aus Pensionsgeschäften auf Sicht und auf Zeit mit Laufzeiten bis zu zwölf Monaten als flüssige Mittel gelten.

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Derivate der zu vereinigenden Teilvermögen werden dahingehend angepasst, dass bei der Risikomessung neu der Commitment-Ansatz II zur Anwendung gelangt (bisher Commitment-Ansatz I) (vgl. § 12 Ziff. 2, 3, 4 Bst. c-f und 8 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). In der Folge lauten die geänderten Bestimmungen wie folgt:

- "2. Bei der Risikomessung gelangt der Commitment-Ansatz II zur Anwendung. Das mit Derivaten verbundene Gesamtengagement des Teilvermögens darf somit 100% seines Nettovermögens und das Gesamtengagement insgesamt 200% seines Nettovermögens nicht überschreiten. Unter Berücksichtigung der Möglichkeit der vorübergehenden Kreditaufnahme des Teilvermögens im Umfang von höchstens 10% des Nettovermögens gemäss § 13 Ziff. 2 kann das Gesamtengagement des Teilvermögens insgesamt bis zu 210% seines Nettovermögens betragen. Die Ermittlung des Gesamtengagements erfolgt gemäss Art. 35 KKV-FINMA.
3. Die Fondsleitung kann insbesondere Derivat-Grundformen wie Call- oder Put-Optionen, deren Wert bei Verfall linear von der positiven oder negativen Differenz zwischen dem Verkehrswert des Basiswerts und dem Ausübungspreis abhängt und null wird, wenn die Differenz das andere Vorzeichen hat, Credit Default Swaps (CDS), Swaps, deren Zahlungen linear und pfad-unabhängig vom Wert des Basiswerts oder einem absoluten Betrag abhängen sowie Termingeschäfte (Futures und Forwards), deren Wert linear vom Wert des Basis-werts abhängt, einsetzen. Sie kann zusätzlich auch Kombinationen von Derivat-Grundformen sowie Derivate, deren ökonomische Wirkungsweise weder durch eine Derivat-Grundform noch durch eine Kombination von Derivat-Grundformen beschrieben werden kann (exotische Derivate), einsetzen.
- 4.
- c) Bei einem überwiegenden Einsatz von Zinsderivaten kann der Betrag, der an das Gesamtengagement aus Derivaten anzurechnen ist, mittels international anerkannter Duration-Netting-Regelungen ermittelt werden, sofern die Regelungen zu einer korrekten Ermittlung des Risikoprofils des Teilvermögens führen, die wesentlichen Risiken berücksichtigt werden, die Anwendung dieser Regelungen nicht zu einer ungerechtfertigten Hebelwirkung führt, keine Zinsarbitrage-Strategien verfolgt werden und die Hebelwirkung des Teilvermögens weder durch Anwendung dieser Regelung noch durch Investitionen in kurzfristige Positionen gesteigert wird.
- d) Derivate, die zur reinen Absicherung von Fremdwährungsrisiken eingesetzt werden und nicht zu einer Hebelwirkung führen oder zusätzliche Marktrisiken beinhalten, können ohne die Anforderungen gemäss Bst. b bei der Berechnung des Gesamtengagements aus Derivaten verrechnet werden.
- e) Zahlungsverpflichtungen aus Derivaten müssen dauernd mit geldnahen Mitteln, Forderungswertpapieren und -rechten oder Aktien, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, nach Massgabe der Kollektivanlagengesetzgebung gedeckt sein.
- f) Geht die Fondsleitung mit einem Derivat eine Verpflichtung zur physischen Lieferung eines Basiswerts ein, muss das Derivat mit den entsprechenden Basiswerten gedeckt sein oder mit anderen Anlagen, wenn die Anlagen und die Basiswerte hoch liquide sind und bei einer verlangten Lieferung jederzeit erworben oder verkauft werden können. Die Fondsleitung muss jederzeit uneingeschränkt über diese Basiswerte oder Anlagen verfügen können.
8. Der Prospekt enthält weitere Angaben:
- zur Bedeutung von Derivaten im Rahmen der Anlagestrategie
 - zu den Auswirkungen der Derivatverwendung auf das Risikoprofil der Teilvermögen
 - zu den Gegenparteirisiken von Derivaten
 - zu der aus der Verwendung von Derivaten resultierenden erhöhten Volatilität und dem erhöhten Gesamtengagement (Hebelwirkung)
 - zu den Kreditderivaten
 - zur Sicherheitenstrategie"

2.4 Risikoverteilung und weitere Anlagerestriktionen

Hinsichtlich der Risikoverteilungsvorschriften werden die Indexfonds nicht mehr explizit als eine Ausnahme im Zusammenhang mit dem Einbezug von Anlagen aufgeführt (vgl. Anpassung in § 15 Ziff. 1 Bst. a des Fondsvertrages). Des Weiteren findet in derselben Bestimmung eine Präzisierung statt, wonach die Risikoverteilungsvorschriften für jedes Teilvermögen einzeln gelten (vgl. § 15 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

In Ziff. 3 von § 15 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens ist neu vorgesehen, dass die Fondsleitung einschliesslich der Derivate und strukturierten Produkte höchstens 10% (bisher ebenfalls 10%) des Vermögens eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten anlegen darf. Der Gesamtwert der Effekten und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei welchen mehr als 5% des Vermögens eines Teilvermögens angelegt sind, darf 40% des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens nicht übersteigen. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen von § 15 Ziff. 4 und 5.

Die Fondsleitung hat gemäss der neuen Ziff. 4 in § 15 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens die Limite von 20% (bisher 15%) bei Anlagen von Vermögen eines Teilvermögens in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank zu berücksichtigen.

Die bisherige Bestimmung in Ziffer 5 ist neu in Ziffer 8 aufgeführt.

In der geänderten Ziffer 5 des angepassten Fondsvertrages wird ausgeführt, dass die Fondsleitung höchstens 5% (bisher ebenfalls 5%) des Vermögens eines Teilvermögens in OTC-Geschäften bei derselben Gegenpartei anlegen darf. Ist die Gegenpartei eine Bank, die ihren Sitz in der Schweiz oder in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union hat oder in einem anderen Staat, in welchem sie einer Aufsicht untersteht, die derjenigen in der Schweiz gleichwertig ist, so erhöht sich diese Limite auf 10% des entsprechenden Teilvermögens. Der zweite Absatz der bisherigen Bestimmung in Ziff. 8.3 betreffend die Absicherung von Forderungen aus OTC-Geschäften findet sich neu ebenfalls in Ziffer 5 (vgl. § 15 Ziff. 5 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss § 15 Ziff. 3 bis 5 desselben Emittenten bzw. Schuldners dürfen insgesamt 20% (bisher 15%) des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen (vgl. § 15 Ziff. 6 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Zudem wird neu festgehalten, dass Anlagen gemäss § 15 Ziff. 3 derselben Unternehmensgruppe insgesamt 20% (bisher 15%) des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen dürfen (vgl. § 15 Ziff. 7 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens wird noch eine weitere Ergänzung vorgenommen, wonach die Beschränkungen gemäss § 15 Ziff. 9 und 10 nicht anwendbar auf Effekten und Geldmarktinstrumente sind, die von einem Staat oder einer öffentlich-rechtlichen Körperschaft aus der OECD oder von internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen die Schweiz oder ein Mitgliedstaat der Europäischen Union begeben oder garantiert werden (vgl. § 15 Ziff. 11 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten

In § 22 Ziff. 1 wird die Bestimmung im Zusammenhang mit der Unterscheidung der Anteilklassen der Teilvermögen hinsichtlich Ausschüttung oder Thesaurierung ersatzlos gestrichen.

4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen

In § 18 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird neu ausgeführt, dass dem Anleger eine Ausgabekommission zugunsten der Fondsleitung, der Depotbank und/oder von Vertreibern, bei Zeichnungen in bar zusammen höchstens 5% (bisher 2%) des gemäss § 16 Ziff. 7 des Fondsvertrages modifizierten Nettoinventarwertes der Anteile bzw. bei Einzahlungen in Anlagen zusammen höchstens 5% (bisher 2%) des gemäss § 16 Ziff. 6 des Fondsvertrages berechneten Bewertungs-Nettoinventarwertes belastet werden darf. Der zurzeit massgebliche Höchstsatz ist aus dem Prospekt ersichtlich. Überdies wird nach Angleichung des Fondsvertrages die Bestimmung, wonach dem Anleger bei der Rücknahme von Anteilen keine Rücknahmekommission belastet wird, gestrichen (vgl. § 18 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Des Weiteren entfällt die bisherige Bestimmung in Ziff. 4 von § 18 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens, nach der für die Auszahlung des Liquidationsbetrags im Falle der Auflösung des Umbrella-Fonds oder eines Teilvermögens dem Anleger keine Kommission belastet wird.

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens wird eine Präzisierung vorgenommen, in welcher darauf hingewiesen wird, dass die Fondsleitung zulasten der Teilvermögen eine jährliche maximale Pauschalkommission bezogen auf das Nettofondsvermögen des jeweiligen Teilvermögens in Rechnung stellt, die pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettoinventarwertes dem Fondsvermögen belastet und jeweils am Monatsende ausbezahlt wird. Die jährliche maximale Pauschalkommission pro Anteilsklasse beträgt neu wie folgt (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens):

Anteilsklassen AT CHF, AT EUR, AT GBP, AT USD, AA CHF, AA EUR, AA GBP, AA USD: 1.20%

Anteilsklassen BT CHF, BT EUR, BT GBP, BT USD, BA CHF, BA EUR, BA GBP, BA USD: 0.90%

Anteilsklassen CT CHF, CT EUR, CT GBP, CT USD, CA CHF, CA EUR, CA GBP, CA USD: 0.75%

Anteilsklassen DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD: 0.70%

Anteilsklassen GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD: 0.60%

Anteilsklassen MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, ST CHF, ST EUR, ST GBP, ST USD, SA CHF, SA EUR, SA GBP, SA USD: 0.00%

Bei den Anteilsklassen MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, ST CHF, ST EUR, ST GBP, ST USD, SA CHF, SA EUR, SA GBP und SA USD der Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration Hedged CHF wird keine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Vermögens des Teilvermögens erhoben. 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 des Fondsvertrages genannten vertraglichen Vereinbarungen bzw. Regelungen.

5 Rücknahmebedingungen

In Übereinstimmung mit dem Fondsvertrag des übernehmenden Teilvermögens werden die Zeichnungs- und Rücknahmeanträge für Anteile an jedem Bankwerktag (Auftragstag) bis zu einem bestimmten im Anhang genannten Zeitpunkt von der Depotbank entgegengenommen (vgl. § 17 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gemäss § 16 berechneten Nettoinventarwert je Anteil. Die Präzisierung, wonach der Bewertungstag gestützt auf die Schlusskurse des Vortages basiert, entfällt (vgl. § 17 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Die Bestimmung in § 17 Ziff. 7 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens, der zufolge die Fondsleitung nach Kündigung des Fondsvertrages durch den Anleger auch ohne entsprechenden Antrag des Anlegers beschliessen kann, dem Anleger ganz oder teilweise Anlagen statt einer Barauszahlung zukommen zu lassen, sofern die dadurch entstehenden Kosten und Umtriebe die Interessen der im Teilvermögen verbleibenden Anleger beeinträchtigen würden, wird ersatzlos gestrichen.

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die zu vereinigenden Teilvermögen bestehen auf unbestimmte Zeit. Beim übertragenden Teilvermögen kann die Fondsleitung oder die Depotbank die Auflösung des Teilvermögens durch Kündigung des Fondsvertrages fristlos herbeiführen (vgl. § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Beim übernehmenden Teilvermögen besteht hingegen eine einmonatige Kündigungsfrist (vgl. § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens). Entsprechend wird der Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens dahingehend angepasst, dass in § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages eine Kündigungsfrist von einem Monat eingeführt wird.

Teil III – Schaffung neuer Anteilsklassen beim übernehmenden Umbrella-Fonds

Im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate sind beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate Anpassungen betreffend die Schaffung neuer Anteilsklassen vorgesehen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen.

Neu hinzukommende Anteilsklassen

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate sollen die Anteilsklassen AA EUR, BA EUR, CT EUR, DA EUR und GT EUR neu aufgenommen werden (vgl. § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens). Bis anhin waren Anteilsklassen mit der Anteilsklassenwährung EUR nicht vorgesehen.

Die maximale pauschale Verwaltungskommission (PVK) der neu geschaffenen Anteilsklassen beträgt wie folgt (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens):

Anteilsklasse AA EUR: 1.20%

Anteilsklasse BA EUR: 0.90%

Anteilsklasse CT EUR: 0.75%

Anteilsklasse DA EUR: 0.70%

Anteilsklasse GT EUR: 0.60%

Im Einklang mit dem bestehenden Klassenkonzept gilt für die neuen Anteilsklassen betreffend **Anlegerkreis** folgendes:

Anteile der **Anteilsklassen "A"** werden allen Anlegern angeboten und können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

Anteile der **Anteilsklassen "B"** werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vertrag mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

Anteile der **Anteilsklassen "C"** werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Anlageberatungsvertrag mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

Anteile der **Anteilsklassen "D"** 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^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklasse 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 Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklasse ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Die Anteile können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

Anteile der **Anteilsklassen "G"** 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^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklasse 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 Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklasse ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} 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.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Teil II Ziff. 2 und 5 sowie Teil III der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge 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 der Fondsverträge Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen der Teilvermögen in bar verlangen können bzw. den Antrag auf Sachauslage stellen können.

Die Einführung neuer Anteilsklassen stellt allerdings keine Änderung des Fondsvertrages im Sinne von Art. 27 KAG dar. Gegen die damit verbundenen, in Teil III dieser Publikation erläuterten, Änderungen in § 6 Ziff. 4 und § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds besteht somit kein Einspruchrecht.

Der Fondsvertrag mit Anhang des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund, der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 8. März 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich