

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. WORLD

Jahresbericht per 28.02.2023

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	11705249	CHF
MT CHF	51786228	CHF
NT CHF	11705248	CHF
XT CHF	30978861	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Zürich, 28. Juni 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

Swisscanto (CH) Index Fund I, Zürich

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten 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 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

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

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020	01.03.2019
	bis	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021	29.02.2020
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		142'615'341.77	213'997'950.90	242'222'787.22	238'047'423.44
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'921'029.57	3'171'408.18	3'370'050.30	4'150'848.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'184.732	25'335.951	25'337.000	30'650.974
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.5547	125.1742	133.0091	135.4231
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		119.0234	136.4371	146.9226	139.9071
Thesaurierung je Anteil		3.45	3.67	3.57	3.68
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.20 %	0.20 %	0.22 %	0.22 %
Klasse MT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'397.04	9'410.95	9'986.90	10'048.59
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000	100.000	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.9704	94.1095	99.8690	100.4859
Thesaurierung je Anteil		2.76	2.96	2.90	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		138'169'103.07	209'113'981.66	236'645'060.90	231'647'624.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'213'306.199	1'638'450.447	1'747'231.290	1'682'510.775
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		113.8782	127.6291	135.4400	137.6797
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		121.5025	139.1129	149.6079	142.2385
Thesaurierung je Anteil		3.75	4.01	3.93	4.03
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse XT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'516'812.09	1'703'150.11	2'197'689.12	2'238'901.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'416.610	16'416.610	19'920.315	19'920.315
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.3950	103.7455	110.3240	112.3929
Thesaurierung je Anteil		2.75	2.92	2.87	2.96
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.31 %	0.31 %	0.31 %	0.31 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF	-9.88 %	-15.65 %	-0.72 %	1.01 %
Klasse MT CHF (Lancierung 30.01.2020)	-9.70 %	-15.48 %	-0.51 %	0.03 %
Klasse NT CHF	-9.70 %	-15.48 %	-0.50 %	1.23 %
Klasse XT CHF	-9.98 %	-15.74 %	-0.82 %	0.92 %
Benchmark	-9.97 %	-15.78 %	-0.47 %	1.17 %
Tracking Error 33)	0.19 %	0.19 %	-0.47 %	0.49 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	0.09 %
Klasse MT CHF (Lancierung 30.01.2020)	0.27 %
Klasse NT CHF	0.27 %
Klasse XT CHF	-0.01 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	28.02.2023	28.02.2022
Bankguthaben auf Sicht	3'155'304.72	1'426'938.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	17'707'075.60	32'449'486.22
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	121'021'377.49	179'712'737.07
Sonstige Vermögenswerte	732'394.82	940'098.95
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	142'616'152.63	214'529'260.60
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-530'407.39
Andere Verbindlichkeiten	-810.86	-902.31
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	142'615'341.77	213'997'950.90

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		25'335.951	25'337.000
Ausgegebene Anteile		3'966.599	1'054.557
Zurückgenommene Anteile		-3'117.818	-1'055.606
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'184.732	25'335.951

Klasse MT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'638'450.447	1'747'231.290
Ausgegebene Anteile		197'304.118	206'610.754
Zurückgenommene Anteile		-554'898.366	-315'391.597
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-67'550.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'213'306.199	1'638'450.447

Klasse XT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'416.610	19'920.315
Zurückgenommene Anteile		-	-3'503.705
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		16'416.610	16'416.610

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	20.07.2022	8'038'929.61	67'550.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		213'997'950.90	242'222'787.22
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'309'960.29	-2'510'004.85
Saldo aus dem Anteilverkehr		-47'553'918.31	-14'237'709.89
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-21'518'730.53	-11'477'121.58
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		142'615'341.77	213'997'950.90

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'144.48	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-695.42	-2'074.02
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		934'164.81	366'933.51
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		5'180'647.49	6'962'520.78
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		255'856.40	625'244.36
Total Ertrag		6'371'117.76	7'952'624.63
Aufwand			
Passivzinsen		-1'636.15	-198.50
Reglementarische Vergütungen		-10'386.86	-13'605.10
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'665'874.26	-1'212'554.86
Total Aufwand		-1'677'897.27	-1'226'358.46
Nettoertrag / Verlust		4'693'220.49	6'726'266.17
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-13'365'670.08	-750'541.89
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		126'778.25	111'259.50
Realisierter Erfolg		-8'545'671.34	6'086'983.78
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-12'973'059.19	-17'564'105.36
Gesamterfolg		-21'518'730.53	-11'477'121.58

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	90'408.07	93'101.85
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	90'408.07	93'101.85
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	31'642.82	32'585.65
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	58'765.25	60'516.20
Total	90'408.07	93'101.85
Klasse MT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	276.87	296.44
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	276.87	296.44
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	96.90	103.75
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	179.97	192.69
Total	276.87	296.44
Klasse NT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	4'557'286.67	6'584'771.15
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'557'286.67	6'584'771.15
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'595'050.33	2'304'669.90
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'962'236.34	4'280'101.25
Total	4'557'286.67	6'584'771.15
Klasse XT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	45'248.88	48'096.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	45'248.88	48'096.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	15'837.11	16'833.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	29'411.77	31'262.87
Total	45'248.88	48'096.73

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							17'707'075.60	12.42	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							17'707'075.60	12.42	
AT0000A2QL75	1.0000 % VIGAV 1 03/26/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	66.72%	66'313.71	0.05	a)
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366842	1.2500 % CS 1 1/4 07/17/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979627	0.6250 % CS 0 5/8 01/18/33 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335732	2.1250 % CS 2 1/8 10/13/26	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2BPA51	0.8750 % BASGR 0 7/8 10/06/31 EMTN	151	0	151	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2LQNQ6	0.7500 % PBBGR 0 3/4 02/07/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3KNP96	0.7500 % TRAGR 0 3/4 03/24/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.44%	80'942.74	0.06	a)
DK0030485271	0.1250 % ENXFP 0 1/8 05/17/26	100	0	0	100 EUR	88.57%	88'037.59	0.06	a)
DK0030486592	1.5000 % ENXFP 1 1/2 05/17/41	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0000471930	8.1250 % ORAFP 8 1/8 01/28/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010800540	4.6250 % EDF 4 5/8 09/11/24 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.27%	100'655.85	0.07	a)
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.56%	100'945.09	0.07	a)
FR0011911247	2.3750 % ENGIFP 2 3/8 05/19/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012444750	4.2500 % ACAFP 4 1/4 PERP	0	100	0	100 EUR	96.88%	96'289.40	0.07	a)
FR0012602761	1.0000 % ENGIFP 1 03/13/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012949923	1.7500 % VIEFP 1 3/4 09/10/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.46%	94'885.94	0.07	a)
FR0013152899	1.0000 % RTEFRA 1 10/19/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.89%	90'337.60	0.06	a)
FR0013203734	4.7500 % ACAFP 4 3/4 09/27/48	0	100	0	100 EUR	97.00%	96'413.65	0.07	a)
FR0013213295	1.0000 % EDF 1 10/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.03%	90'477.75	0.06	a)
FR0013264421	1.5000 % CTEFRA 1 1/2 07/29/28	0	100	0	100 EUR	88.09%	87'558.50	0.06	a)
FR0013284270	2.0000 % ENGIFP 2 09/28/37 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013311347	0.7500 % HOFPP 0 3/4 01/23/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013421815	1.0000 % ACAFP 1 07/03/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.94%	83'429.61	0.06	a)
FR0013444544	0.1250 % DSYFP 0 1/8 09/16/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013455821	1.2500 % ENGIFP 1 1/4 10/24/41	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013465424	2.0000 % EDF 2 12/09/49 EMTN	0	100	0	100 EUR	59.09%	58'736.79	0.04	a)
FR0013476595	0.6640 % VIEFP 0.664 01/15/31 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013504677	1.7500 % ENGIFP 1 3/4 03/27/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013512449	1.2500 % VIEFP 1 1/4 05/14/35 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013522703	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 07/08/40 EMTN	0	100	0	100 EUR	65.61%	65'208.43	0.05	a)
FR0013523602	2.0000 % ACAFP 2 07/17/30	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000Y93	0.1250 % ACAFP 0 1/8 12/09/27 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002G36	0.7500 % SAFFP 0 3/4 03/17/31	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003182	0.3750 % ACAFP 0 3/8 04/20/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	82.35%	81'855.19	0.06	a)
FR0014006U00	1.0000 % EDF 1 11/29/33 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007MK3	1.1250 % ACAFP 1 1/8 07/12/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	76.77%	76'307.92	0.05	a)
FR0014008MT2	1.1250 % ACAFP 1 1/8 02/24/29 EMTN	0	200	100	100 EUR	85.77%	85'248.55	0.06	a)
XS0625859516	4.5000 % INVSA 4 1/2 05/12/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0857662448	2.3750 % MCD 2 3/8 11/27/24 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0881362502	2.3750 % TOYOTA 2 3/8 02/01/23 EMTN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0906815591	2.7500 % PM 2 3/4 03/19/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0909359332	2.7500 % BATSLN 2 3/4 03/25/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.75%	97'155.14	0.07	a)
XS0925599556	2.2500 % WFC 2 1/4 05/02/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0935427970	2.8750 % JPM 2 7/8 05/24/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.33%	93'757.80	0.07	a)
XS0951216166	3.1250 % ORCL 3 1/8 07/10/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1023703090	3.6250 % ENIIM 3 5/8 01/29/29 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1030900242	3.2500 % VZ 3 1/4 02/17/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.66%	98'066.60	0.07	a)
XS1069521083	2.3750 % ACAFP 2 3/8 05/20/24 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1087831688	2.6250 % ACEIM 2 5/8 07/15/24 EMTN	100	100	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1143916465	1.6250 % LIN 1 5/8 12/01/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1146286205	2.6250 % VZ 2 5/8 12/01/31	100	0	0	100 EUR	89.45%	88'910.28	0.06 a)	
XS1174469137	1.5000 % JPM 1 1/2 01/27/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.04%	95'457.46	0.07 a)	
XS1196503137	1.8000 % BKNG 1.8 03/03/27	100	0	0	100 EUR	92.42%	91'860.34	0.06 a)	
XS1197270819	1.6250 % MDLZ 1 5/8 03/08/27	0	100	0	100 EUR	90.87%	90'323.69	0.06 a)	
XS1199964575	1.1250 % RYAI 1 1/8 03/10/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1200679071	1.1250 % BRK 1 1/8 03/16/27	100	0	0	100 EUR	89.73%	89'188.59	0.06 a)	
XS1200679667	1.6250 % BRK 1 5/8 03/16/35	100	0	0	100 EUR	77.74%	77'269.08	0.05 a)	
XS1204154410	2.6250 % ACAFP 2 5/8 03/17/27	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1310934382	2.0000 % WFC 2 04/27/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1366026919	2.2500 % HON 2 1/4 02/22/28	100	0	0	100 EUR	92.16%	91'601.91	0.06 a)	
XS1379122101	1.5000 % AMXLMM 1 1/2 03/10/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1395021089	1.2500 % ACAFP 1 1/4 04/14/26 EMTN	0	200	100	100 EUR	92.61%	92'053.17	0.06 a)	
XS1396285279	1.5000 % EUROGR 1 1/2 04/18/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.18%	88'637.94	0.06 a)	
XS1397134609	1.0000 % LIN 1 04/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.71%	88'177.74	0.06 a)	
XS1400169931	1.3750 % WFC 1 3/8 10/26/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1402921412	1.5000 % JPM 1 1/2 10/29/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.63%	92'070.06	0.06 a)	
XS1403264291	1.7500 % MCD 1 3/4 05/03/28 GMTN	0	100	0	100 EUR	90.54%	89'994.69	0.06 a)	
XS1405765733	1.2500 % DOV 1 1/4 11/09/26	100	100	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405766624	1.3750 % VZ 1 3/8 11/02/28	100	0	0	100 EUR	87.28%	86'756.38	0.06 a)	
XS1405766897	0.8750 % VZ 0 7/8 04/02/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405769487	0.8750 % PPG 0 7/8 11/03/25	100	0	0	100 EUR	92.88%	92'313.58	0.06 a)	
XS1405775534	1.3750 % TMO 1 3/8 09/12/28	100	0	0	100 EUR	88.24%	87'706.60	0.06 a)	
XS1405775708	0.7500 % TMO 0 3/4 09/12/24	100	0	0	100 EUR	95.51%	94'935.64	0.07 a)	
XS1412711217	1.6250 % ENIIM 1 5/8 05/17/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.92%	88'379.51	0.06 a)	
XS1426022536	1.5460 % SUMIBK 1.546 06/15/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1429673327	2.5000 % PKNPW 2 1/2 06/07/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1493322355	0.6250 % ENIIM 0 5/8 09/19/24 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1497312295	0.8750 % CKHH 0 7/8 10/03/24	100	100	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1505890530	1.1250 % CNUNZ 1 1/8 10/18/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1521039054	3.1250 % GAZPRU 3 1/8 11/17/23 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1538284230	1.8750 % ACAFP 1 7/8 12/20/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.23%	183'344.97	0.13 a)	
XS1574158082	1.0000 % PFE 1 03/06/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1605365193	1.3750 % ACAFP 1 3/8 05/03/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.43%	89'885.35	0.06 a)	
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	0	100	0	100 EUR	87.88%	87'347.78	0.06 a)	
XS1619312173	0.8750 % AAPL 0 7/8 05/24/25	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1619312686	1.3750 % AAPL 1 3/8 05/24/29	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1621087516	1.4130 % SUMIBK 1.413 06/14/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1623404412	0.8500 % USB 0.85 06/07/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1654229373	1.3750 % GYCGR 1 3/8 08/03/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1664644983	2.2500 % BATSLN 2 1/4 01/16/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.49%	80'993.43	0.06 a)	
XS1675764945	0.8720 % MUFG 0.872 09/07/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1716245094	1.8750 % PM 1 7/8 11/06/37	100	0	0	100 EUR	64.59%	64'199.56	0.05 a)	
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1733289406	4.2500 % CASSIM 4 1/4 12/14/47	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1734066811	3.1250 % PVH 3 1/8 12/15/27 REGS	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1753808929	1.7500 % EXOIM 1 3/4 01/18/28	100	0	0	100 EUR	89.49%	88'948.05	0.06 a)	
XS1758752635	0.6800 % MUFG 0.68 01/26/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1785458172	2.1250 % WPC 2 1/8 04/15/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1789751531	1.0000 % CFRVX 1 03/26/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1789752182	1.5000 % CFRVX 1 1/2 03/26/30	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1790990474	1.3750 % ACAFP 1 3/8 03/13/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.19%	94'618.57	0.07 a)	
XS1796208632	1.6250 % SESGFP 1 5/8 03/22/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1801780583	0.5000 % TOYOTA 0 1/2 04/06/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1808482746	1.1250 % HANRUE 1 1/8 04/18/28	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843435923	2.0000 % FIS 2 05/21/30	100	0	0	100 EUR	86.49%	85'968.17	0.06 a)	
XS1843436574	0.7500 % FIS 0 3/4 05/21/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843449122	2.2500 % TACHEM 2 1/4 11/21/26 REGS	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843449395	3.0000 % TACHEM 3 11/21/30 REGS	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1875333178	1.6250 % SHBASS 1 5/8 03/05/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1898256257	1.0000 % SLB 1 02/18/26	100	100	100	100 EUR	92.31%	91'754.98	0.06	a)
XS1951313763	2.1250 % IMBLN 2 1/8 02/12/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.12%	90'570.19	0.06	a)
XS1951927315	2.0000 % BPPEHX 2 02/15/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1963745234	1.6000 % MCD 1.6 03/15/31	0	100	0	100 EUR	83.96%	83'450.49	0.06	a)
XS1979280937	1.2500 % VZ 1 1/4 04/08/30	100	0	0	100 EUR	82.92%	82'420.75	0.06	a)
XS1979490239	1.5000 % BX 1 1/2 04/10/29 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1993969515	1.7500 % SBBBSS 1 3/4 01/14/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2004880832	0.5230 % MIZUHO 0.523 06/10/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010038227	0.9500 % MCO 0.95 02/25/30	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010331440	1.6500 % COF 1.65 06/12/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2015231413	0.6250 % JYBC 0 5/8 06/20/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2019815062	1.4000 % OMC 1.4 07/08/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.89%	81'392.00	0.06	a)
XS2033262622	1.0010 % JPM 1.001 07/25/31 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049630028	0.4020 % MIZUHO 0.402 09/06/29 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049630887	0.1180 % MIZUHO 0.118 09/06/24 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050404636	0.2000 % DHR 0.2 03/18/26	0	100	0	100 EUR	89.75%	89'202.50	0.06	a)
XS2050406094	0.7500 % DHR 0 3/4 09/18/31	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050406177	1.3500 % DHR 1.35 09/18/39	0	100	0	100 EUR	67.12%	66'715.26	0.05	a)
XS2052313827	1.6250 % LYB 1 5/8 09/17/31	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056572154	0.3750 % CKHGTH 0 3/8 10/17/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057069093	0.7500 % CKHGTH 0 3/4 04/17/26	100	0	0	100 EUR	89.81%	89'271.09	0.06	a)
XS2057872595	0.2500 % SPOLNO 0 1/4 09/30/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2058557344	1.8750 % TMO 1 7/8 10/01/49 EMTN	100	0	0	100 EUR	62.02%	61'645.10	0.04	a)
XS2065946837	1.0000 % ENIIM 1 10/11/34 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2067135421	0.3750 % ACAFP 0 3/8 10/21/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.69%	91'130.78	0.06	a)
XS2075811948	1.0470 % JPM 1.047 11/04/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.57%	76'110.13	0.05	a)
XS2079713322	0.3750 % BBVASM 0 3/8 11/15/26 GMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084418339	0.8750 % CEZCP 0 7/8 12/02/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.03%	87'498.86	0.06	a)
XS2085655590	1.0000 % FIS 1 12/03/28	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2091604715	0.3000 % CB 0.3 12/15/24	100	0	0	100 EUR	93.35%	92'783.72	0.07	a)
XS2099704731	0.1250 % BCHINA 0 1/8 01/16/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2104051433	1.0000 % BBVASM 1 01/16/30 GMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2118213888	0.6250 % ANVAU 0 5/8 08/25/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2122485845	0.5000 % DOW 0 1/2 03/15/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2152795709	1.6250 % AIRFP 1 5/8 04/07/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156510021	1.0000 % SHBASS 1 04/15/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.58%	94'011.26	0.07	a)
XS2166755509	2.0000 % SLB 2 05/06/32	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2167007249	1.3380 % WFC 1.338 05/04/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2167007918	1.7410 % WFC 1.741 05/04/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182067350	2.2500 % SCANIA 2 1/4 06/03/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2185867830	1.3750 % AIRFP 1 3/8 06/09/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.06%	92'497.47	0.06	a)
XS2193982803	1.3620 % VTRS 1.362 06/23/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2196322155	0.1420 % XOM 0.142 06/26/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2196322312	0.5240 % XOM 0.524 06/26/28	100	0	0	100 EUR	84.26%	83'749.67	0.06	a)
XS2197356186	1.0000 % IREIM 1 07/01/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	79.29%	78'809.71	0.06	a)
XS2198582301	2.0000 % TACHEM 2 07/09/40	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2201946634	2.3750 % MRLSM 2 3/8 07/13/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.24%	91'681.43	0.06	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2228892860	1.1250 % GLENLN 1 1/8 03/10/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.87%	83'366.00	0.06	a)
XS2238783422	2.3750 % JAPTOB 2 3/8 04/07/2081	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2241387096	0.6930 % MIZUHO 0.693 10/07/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242929532	2.6250 % ENIIM 2 5/8 PERP NC5	0	100	0	100 EUR	91.88%	91'319.63	0.06	a)
XS2251233651	1.1250 % AKFAST 1 1/8 01/11/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2265371042	0.3500 % MQGAU 0.35 03/03/28	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2265968284	0.0100 % SHBASS 0.01 12/02/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.55%	83'046.94	0.06	a)
XS2265990452	0.2500 % HERIM 0 1/4 12/03/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282101539	0.1250 % GYCGR 0 1/8 01/11/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.16%	74'701.69	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2292487076	0.2500 % ACEIM 0 1/4 07/28/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	76.23%	75'773.18	0.05	a)
XS2305026929	0.3420 % NTT 0.342 03/03/30 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2308322002	0.5000 % BKNQ 0 1/2 03/08/28	100	0	0	100 EUR	84.91%	84'392.76	0.06	a)
XS2310797696	1.1250 % SPG 1 1/8 03/19/33	0	100	0	100 EUR	70.66%	70'235.85	0.05	a)
XS2315784806	1.2500 % APAAU 1 1/4 03/15/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2329144591	0.8430 % MIZUHO 0.843 04/12/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2334857138	2.7500 % ENIIM 2 3/4 PERP NC9	0	100	0	100 EUR	78.38%	77'901.23	0.05	a)
XS2360853332	1.2880 % PRXNA 1.288 07/13/29 REGS	100	0	0	100 EUR	76.52%	76'057.45	0.05	a)
XS2363203089	1.9850 % PRXNA 1.985 07/13/33 REGS	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2381671671	0.2500 % CS 0 1/4 09/01/28 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384726449	1.2500 % MDLZ 1 1/4 09/09/41 REGS	0	100	0	100 EUR	63.42%	63'037.63	0.04	a)
XS2386592484	0.1250 % ADENVX 0 1/8 09/21/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.31%	80'820.48	0.06	a)
XS2399154181	0.9540 % WESAU 0.954 10/21/33 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2402178300	0.7500 % CKHH 0 3/4 11/02/29	0	100	0	100 EUR	78.86%	78'381.31	0.05	a)
XS2430998893	0.8750 % BBVASM 0 7/8 01/14/29	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462466611	1.5000 % AKZANA 1 1/2 03/28/28 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462468740	2.0000 % AKZANA 2 03/28/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2465984107	1.6310 % MIZUHO 1.631 04/08/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.19%	89'640.84	0.06	a)
XS2479941572	2.0000 % V 2 06/15/29	0	100	0	100 EUR	91.50%	90'942.92	0.06	a)
EUR							6'677'879.69	4.68	
US00507VAK52	3.4000 % ATVI 3.4 09/15/26	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US010392FR41	3.7000 % SO 3.7 12/01/47 B	60	0	0	60 USD	76.15%	42'824.02	0.03	a)
US010392FS24	4.3000 % SO 4.3 07/15/48 A	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAQ50	3.6000 % BABA 3.6 11/28/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	200	0	0	200 USD	91.88%	172'228.50	0.12	a)
US01609WAV46	4.2000 % BABA 4.2 12/06/47	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02005NAV29	5.1250 % ALLY 5 1/8 09/30/24	100	100	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02005NBQ25	4.7500 % ALLY 4 3/4 06/09/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DA29	4.5000 % AIG 4 1/2 07/16/44	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DB02	4.3750 % AIG 4 3/8 01/15/55	75	0	75	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DC84	3.8750 % AIG 3 7/8 01/15/35	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DH71	3.9000 % AIG 3.9 04/01/26	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DP97	4.3750 % AIG 4 3/8 06/30/50	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DQ70	2.5000 % AIG 2 1/2 06/30/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DR53	3.4000 % AIG 3.4 06/30/30	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03076CAF32	4.0000 % AMP 4 10/15/23	160	0	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162BZ23	4.4000 % AMGN 4.4 05/01/45	90	0	0	90 USD	83.35%	70'309.58	0.05	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	180	0	180	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CF59	4.6630 % AMGN 4.663 06/15/51	275	0	0	275 USD	85.88%	221'344.41	0.16	a)
US031162CJ71	2.6000 % AMGN 2.6 08/19/26	100	0	0	100 USD	91.94%	86'172.83	0.06	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	90	0	0	90 USD	80.95%	68'284.87	0.05	a)
US04686JAC53	3.5000 % ATH 3 1/2 01/15/31	100	0	0	100 USD	83.84%	78'578.38	0.06	a)
US049560AL95	4.1500 % ATO 4.15 01/15/43	130	0	130	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US049560AN51	3.0000 % ATO 3 06/15/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US049560AW50	2.8500 % ATO 2.85 02/15/52	0	100	0	100 USD	64.84%	60'767.26	0.04	a)
US054561AM77	5.0000 % EQH 5 04/20/48	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05526DBB01	3.5570 % BATSLN 3.557 08/15/27	90	0	0	90 USD	91.11%	76'851.45	0.05	a)
US05526DBD66	4.3900 % BATSLN 4.39 08/15/37	100	0	0	100 USD	77.67%	72'793.02	0.05	a)
US05526DBF15	4.5400 % BATSLN 4.54 08/15/47	115	0	0	115 USD	72.16%	77'780.32	0.05	a)
US05526DBN49	4.9060 % BATSLN 4.906 04/02/30	90	0	0	90 USD	92.11%	77'700.38	0.05	a)
US05526DBS36	2.7260 % BATSLN 2.726 03/25/31	190	0	100	90 USD	77.79%	65'616.54	0.05	a)
US05531FBJ12	2.2000 % TFC 2.2 03/16/23 MTN	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US056752AM06	4.3750 % BIDU 4 3/8 05/14/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US084659AR23	4.4500 % BRKHEC 4.45 01/15/49	100	0	0	100 USD	85.62%	80'249.69	0.06	a)
US084664BU46	4.4000 % BRK 4.4 05/15/42	120	0	0	120 USD	92.43%	103'955.01	0.07	a)
US084664CQ25	4.2000 % BRK 4.2 08/15/48	90	0	0	90 USD	88.47%	74'630.79	0.05	a)
US084664CR08	4.2500 % BRK 4 1/4 01/15/49	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US084664CV10	2.8500 % BRK 2.85 10/15/50	90	0	0	90 USD	68.18%	57'510.86	0.04	a)
US096630AH15	3.4000 % BWP 3.4 02/15/31	100	0	0	100 USD	84.75%	79'432.87	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US097023CN34	2.9500 % BA 2.95 02/01/30	100	0	0	100 USD	84.95%	79'618.92	0.06	a)
US097023CT04	4.8750 % BA 4 7/8 05/01/25	190	0	90	100 USD	98.47%	92'293.35	0.06	a)
US097023CV59	5.7050 % BA 5.705 05/01/40	100	0	0	100 USD	95.62%	89'623.59	0.06	a)
US097023CW33	5.8050 % BA 5.805 05/01/50	280	0	100	180 USD	95.31%	160'786.16	0.11	a)
US097023CY98	5.1500 % BA 5.15 05/01/30	200	0	100	100 USD	96.44%	90'383.89	0.06	a)
US097023DC69	3.6250 % BA 3 5/8 02/01/31	100	0	0	100 USD	87.59%	82'094.20	0.06	a)
US097023DG73	2.1960 % BA 2.196 02/04/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US10922NAF06	4.7000 % BHF 4.7 06/22/47	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US11271LAB80	4.7000 % BNCN 4.7 09/20/47	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US11271LAD47	4.8500 % BNCN 4.85 03/29/29	90	0	0	90 USD	95.87%	80'869.08	0.06	a)
US12503MAA62	3.6500 % CBOE 3.65 01/12/27	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12572QAG01	3.0000 % CME 3 03/15/25	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12572QAH83	4.1500 % CME 4.15 06/15/48	100	0	0	100 USD	90.13%	84'470.59	0.06	a)
US127097AG80	3.9000 % CTRA 3.9 05/15/27	0	50	0	50 USD	93.59%	43'857.58	0.03	a)
US14040HBD61	3.5000 % COF 3 1/2 06/15/23	95	0	95	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HBJ32	4.2000 % COF 4.2 10/29/25	100	0	0	100 USD	96.38%	90'334.12	0.06	a)
US14040HBK05	3.7500 % COF 3 3/4 07/28/26	90	0	0	90 USD	93.81%	79'128.80	0.06	a)
US14040HBT14	3.3000 % COF 3.3 10/30/24	100	0	0	100 USD	96.37%	90'324.19	0.06	a)
US14040HBW43	3.8000 % COF 3.8 01/31/28	125	0	0	125 USD	92.52%	108'388.16	0.08	a)
US15089QAM69	6.1650 % CE 6.165 07/15/27	0	100	0	100 USD	99.45%	93'210.45	0.07	a)
US15089QAP90	6.3790 % CE 6.379 07/15/32	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAR56	5.9000 % CE 5.9 07/05/24	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAV36	3.3750 % CNC 3 3/8 02/15/30	0	100	50	50 USD	84.38%	39'540.23	0.03	a)
US15135BAW19	3.0000 % CNC 3 10/15/30	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAX91	2.5000 % CNC 2 1/2 03/01/31	0	100	0	100 USD	78.40%	73'478.71	0.05	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	0	200	100	100 USD	83.63%	78'377.53	0.05	a)
US161175AZ73	6.3840 % CHTR 6.384 10/23/35	115	0	0	115 USD	95.90%	103'362.79	0.07	a)
US161175BA14	6.4840 % CHTR 6.484 10/23/45	264	0	140	124 USD	91.32%	106'126.78	0.07	a)
US161175BL78	5.3750 % CHTR 5 3/8 05/01/47	140	0	140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BM51	5.3750 % CHTR 5 3/8 04/01/38	110	0	110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BN35	5.7500 % CHTR 5 3/4 04/01/48	215	0	0	215 USD	83.31%	167'876.94	0.12	a)
US161175BU77	2.8000 % CHTR 2.8 04/01/31	185	0	0	185 USD	78.45%	136'024.23	0.10	a)
US21036PAL22	4.2500 % STZ 4 1/4 05/01/23	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21036PAQ19	3.7000 % STZ 3.7 12/06/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21036PAS74	3.5000 % STZ 3 1/2 05/09/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21036PAY43	3.6000 % STZ 3.6 02/15/28	190	0	190	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21036PAZ18	4.1000 % STZ 4.1 02/15/48	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219350BF12	4.3750 % GLW 4 3/8 11/15/57	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25179MAL72	5.6000 % DVN 5.6 07/15/41	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25179MAU71	5.0000 % DVN 5 06/15/45	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25179MBF95	4.5000 % DVN 4 1/2 01/15/30	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25179SAD27	7.8750 % DVN 7 7/8 09/30/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US253393AF94	3.1500 % DKS 3.15 01/15/32	0	50	0	50 USD	78.92%	36'986.13	0.03	a)
US253393AG77	4.1000 % DKS 4.1 01/15/52	0	50	0	50 USD	65.83%	30'848.18	0.02	a)
US254709AK45	3.9500 % DFS 3.95 11/06/24	50	0	0	50 USD	97.40%	45'643.79	0.03	a)
US254709AM01	4.1000 % DFS 4.1 02/09/27	80	0	0	80 USD	94.53%	70'876.27	0.05	a)
US254709AP32	4.5000 % DFS 4 1/2 01/30/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DBG34	5.3000 % WBD 5.3 05/15/49	100	0	0	100 USD	80.44%	75'396.42	0.05	a)
US25470DBH17	4.6500 % WBD 4.65 05/15/50	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26078JAC45	4.4930 % DD 4.493 11/15/25	0	100	50	50 USD	98.31%	46'070.80	0.03	a)
US26078JAD28	4.7250 % DD 4.725 11/15/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26078JAF75	5.4190 % DD 5.419 11/15/48	0	100	50	50 USD	95.86%	44'924.03	0.03	a)
US26138EAS81	3.4000 % KDP 3.4 11/15/25	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26884LAF67	3.9000 % EQT 3.9 10/01/27	0	100	0	100 USD	91.00%	85'289.75	0.06	a)
US26884LAG41	7.0000 % EQT 7 02/01/30	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AE95	7.3750 % ECOPET 7 3/8 09/18/43	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AJ82	5.8750 % ECOPET 5 7/8 05/28/45	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AK55	4.1250 % ECOPET 4 1/8 01/16/25	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AN94	6.8750 % ECOPET 6 7/8 04/29/30	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US29273RAP47	6.0500 % ET 6.05 06/01/41	100	0	0	100 USD	95.66%	89'656.49	0.06	a)
US29273RAR03	6.5000 % ET 6 1/2 02/01/42	50	0	0	50 USD	99.48%	46'617.50	0.03	a)
US29273RBE80	4.9000 % ET 4.9 03/15/35	100	0	0	100 USD	89.92%	84'275.36	0.06	a)
US29273RBL24	5.3000 % ET 5.3 04/15/47	50	0	0	50 USD	84.80%	39'741.09	0.03	a)
US29278NAH61	4.5000 % ET 4 1/2 04/15/24	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278NAQ60	3.7500 % ET 3 3/4 05/15/30	90	0	0	90 USD	88.77%	74'879.04	0.05	a)
US29279FAA75	6.2500 % ET 6 1/4 04/15/49	140	0	0	140 USD	95.08%	124'758.04	0.09	a)
US30212PAJ49	4.5000 % EXPE 4 1/2 08/15/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30212PAR64	3.2500 % EXPE 3 1/4 02/15/30	100	0	0	100 USD	84.20%	78'914.29	0.06	a)
US31620MBR60	1.1500 % FIS 1.15 03/01/26	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US337738AP30	3.8500 % FISV 3.85 06/01/25	185	0	185	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US337738AU25	3.5000 % FISV 3 1/2 07/01/29	140	0	140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US337738AV08	4.4000 % FISV 4.4 07/01/49	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36186CBY84	8.0000 % ALLY 8 11/01/31	185	100	185	100 USD	108.47%	101'658.91	0.07	a)
US373334JW27	4.3000 % SO 4.3 03/15/42	50	0	0	50 USD	83.77%	39'255.59	0.03	a)
US403949AB64	5.8750 % DINO 5 7/8 04/01/26	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404119BN87	5.0000 % HCA 5 03/15/24	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404119BT57	5.2500 % HCA 5 1/4 06/15/26	50	0	0	50 USD	98.40%	46'112.70	0.03	a)
US404119BU21	4.5000 % HCA 4 1/2 02/15/27	90	0	0	90 USD	95.75%	80'767.52	0.06	a)
US42225UAG94	3.1000 % HR 3.1 02/15/30	0	100	0	100 USD	86.29%	80'873.90	0.06	a)
US42225UAH77	2.0000 % HR 2 03/15/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US423452AG66	2.9000 % HP 2.9 09/29/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US436106AA64	5.8750 % HFC 5 7/8 04/01/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US438516BL94	2.5000 % HON 2 1/2 11/01/26	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US438516BZ80	1.9500 % HON 1.95 06/01/30	90	0	0	90 USD	82.60%	69'674.74	0.05	a)
US45866FAD69	3.7500 % ICE 3 3/4 12/01/25	90	0	0	90 USD	96.34%	81'261.15	0.06	a)
US45866FAH73	4.2500 % ICE 4 1/4 09/21/48	140	0	80	60 USD	86.09%	48'414.90	0.03	a)
US45866FAK03	2.1000 % ICE 2.1 06/15/30	100	0	0	100 USD	81.23%	76'131.97	0.05	a)
US45866FAN42	1.8500 % ICE 1.85 09/15/32	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45866FAQ72	3.0000 % ICE 3 09/15/60	100	0	0	100 USD	63.18%	59'214.71	0.04	a)
US46817MAK36	3.1250 % JXN 3 1/8 11/23/31 144A	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46817MAL19	3.1250 % JXN 3 1/8 11/23/31	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46817MAM91	4.0000 % JXN 4 11/23/51 144A	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46817MAN74	4.0000 % JXN 4 11/23/51	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47215PAC05	3.8750 % JD 3 7/8 04/29/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47215PAE60	3.3750 % JD 3 3/8 01/14/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47233JBH05	4.1500 % JEF 4.15 01/23/30	115	0	50	65 USD	90.56%	55'169.50	0.04	a)
US49271VAF76	4.5970 % KDP 4.597 05/25/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49271VAJ98	3.2000 % KDP 3.2 05/01/30	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50540RAQ56	3.6000 % LH 3.6 02/01/25	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50540RAS13	4.7000 % LH 4.7 02/01/45	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55261FAJ30	3.5500 % MTB 3.55 07/26/23	215	0	215	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAC72	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24 144A	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAG86	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27 144A	0	200	0	200 USD	91.34%	171'211.02	0.12	a)
US55903VAL71	4.2790 % WBD 4.279 03/15/32 144A	0	300	100	200 USD	86.15%	161'481.99	0.11	a)
US55903VAQ68	5.1410 % WBD 5.141 03/15/52 144A	0	400	300	100 USD	78.72%	73'784.44	0.05	a)
US55903VAS25	5.3910 % WBD 5.391 03/15/62 144A	0	200	100	100 USD	77.74%	72'864.81	0.05	a)
US595620AM78	3.5000 % BRKHEC 3 1/2 10/15/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59562VAM90	6.1250 % BRKHEC 6 1/8 04/01/36	80	0	0	80 USD	105.85%	79'364.76	0.06	a)
US59562VAP22	5.9500 % BRKHEC 5.95 05/15/37	80	0	0	80 USD	103.26%	77'422.10	0.05	a)
US59562VBD82	5.1500 % BRKHEC 5.15 11/15/43	80	0	0	80 USD	94.42%	70'794.84	0.05	a)
US606822AD62	3.8500 % MUFG 3.85 03/01/26	200	0	0	200 USD	95.43%	178'884.85	0.13	a)
US606822AR58	3.2870 % MUFG 3.287 07/25/27	140	0	0	140 USD	92.18%	120'954.38	0.08	a)
US606822AV60	3.9610 % MUFG 3.961 03/02/28	140	0	0	140 USD	94.25%	123'673.02	0.09	a)
US606822BA15	3.7610 % MUFG 3.761 07/26/23	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BK96	3.7510 % MUFG 3.751 07/18/39	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BM52	3.1950 % MUFG 3.195 07/18/29	200	0	0	200 USD	87.80%	164'579.98	0.12	a)
US606822BN36	2.1930 % MUFG 2.193 02/25/25	200	0	0	200 USD	93.69%	175'617.03	0.12	a)
US60687YAG44	2.8390 % MIZUHO 2.839 09/13/26	0	200	0	200 USD	91.39%	171'318.05	0.12	a)
US60687YAM12	3.1700 % MIZUHO 3.17 09/11/27	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US60687YAX76	3.1530 % MIZUHO 3.153 07/16/30	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YBL20	1.9790 % MIZUHO 1.979 09/08/31	0	200	0	200 USD	77.55%	145'358.66	0.10	a)
US628530BC02	5.4000 % VTRS 5.4 11/29/43	65	0	65	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62854AAN46	3.9500 % VTRS 3.95 06/15/26	190	0	190	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62854AAP93	5.2500 % VTRS 5 1/4 06/15/46	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	110	0	0	110 USD	91.40%	94'230.29	0.07	a)
US655844BS65	2.9000 % NSC 2.9 06/15/26	50	0	0	50 USD	92.94%	43'552.09	0.03	a)
US681936BM17	3.3750 % OHI 3 3/8 02/01/31	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XAE58	6.5000 % ORCL 6 1/2 04/15/38	0	100	0	100 USD	104.10%	97'567.54	0.07	a)
US68389XAM74	5.3750 % ORCL 5 3/8 07/15/40	0	200	100	100 USD	91.36%	85'625.19	0.06	a)
US68389XAV73	4.3000 % ORCL 4.3 07/08/34	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XAW56	4.5000 % ORCL 4 1/2 07/08/44	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBC83	2.9500 % ORCL 2.95 05/15/25	0	200	100	100 USD	94.86%	88'908.28	0.06	a)
US68389XBF15	4.1250 % ORCL 4 1/8 05/15/45	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBG97	4.3750 % ORCL 4 3/8 05/15/55	0	100	0	100 USD	75.43%	70'695.08	0.05	a)
US68389XBH70	3.8500 % ORCL 3.85 07/15/36	0	200	100	100 USD	81.48%	76'368.82	0.05	a)
US68389XBJ37	4.0000 % ORCL 4 07/15/46	0	100	0	100 USD	72.77%	68'202.75	0.05	a)
US68389XBM65	2.6500 % ORCL 2.65 07/15/26	0	300	200	100 USD	91.30%	85'569.80	0.06	a)
US68389XBN49	3.2500 % ORCL 3 1/4 11/15/27	0	200	100	100 USD	91.35%	85'620.22	0.06	a)
US68389XBQ79	4.0000 % ORCL 4 11/15/47	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBS36	2.9500 % ORCL 2.95 11/15/24	0	100	0	100 USD	95.88%	89'862.41	0.06	a)
US68389XBT19	2.5000 % ORCL 2 1/2 04/01/25	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBV64	2.9500 % ORCL 2.95 04/01/30	0	200	100	100 USD	85.41%	80'046.49	0.06	a)
US68389XBX21	3.6000 % ORCL 3.6 04/01/50	0	200	100	100 USD	67.72%	63'472.16	0.04	a)
US68389XBY04	3.8500 % ORCL 3.85 04/01/60	0	100	0	100 USD	66.79%	62'599.21	0.04	a)
US68389XCA19	3.9500 % ORCL 3.95 03/25/51	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XCB91	4.1000 % ORCL 4.1 03/25/61	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XCE31	2.8750 % ORCL 2 7/8 03/25/31	0	100	0	100 USD	82.70%	77'508.98	0.05	a)
US686330AJ06	3.7000 % ORIX 3.7 07/18/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US686330AK78	3.2500 % ORIX 3 1/4 12/04/24	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718172AC39	6.3750 % PM 6 3/8 05/16/38	130	0	130	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718172AM11	4.3750 % PM 4 3/8 11/15/41	60	0	0	60 USD	82.47%	46'378.97	0.03	a)
US718172AU37	3.8750 % PM 3 7/8 08/21/42	110	0	0	110 USD	76.23%	78'589.57	0.06	a)
US718172CB38	3.1250 % PM 3 1/8 08/17/27	190	0	0	190 USD	92.46%	164'652.42	0.12	a)
US718546AH74	5.8750 % PSX 5 7/8 05/01/42	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718546AL86	4.8750 % PSX 4 7/8 11/15/44	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718546AV68	3.8500 % PSX 3.85 04/09/25	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74460WAE75	2.3000 % PSA 2.3 05/01/31	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US745867AX94	5.0000 % PHM 5 01/15/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109AV67	3.8750 % O 3 7/8 04/15/25	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US75886FAF45	2.8000 % REGN 2.8 09/15/50	140	0	140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US761713BG06	4.4500 % BATSLN 4.45 06/12/25	244	0	244	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78486QAF81	1.8000 % SIVB 1.8 02/02/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAF13	3.7000 % CRM 3.7 04/11/28	90	0	0	90 USD	95.16%	80'270.94	0.06	a)
US808513AU91	3.2000 % SCHW 3.2 01/25/28	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BB02	4.2000 % SCHW 4.2 03/24/25	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BF16	0.9000 % SCHW 0.9 03/11/26	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BS37	2.3000 % SCHW 2.3 05/13/31	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BW49	3.3000 % SCHW 3.3 04/01/27	110	0	110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82481LAD10	3.2000 % TACHEM 3.2 09/23/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US842587CV72	3.2500 % SO 3 1/4 07/01/26	100	0	0	100 USD	93.90%	88'005.06	0.06	a)
US842587CW55	4.2500 % SO 4 1/4 07/01/36	140	0	0	140 USD	86.44%	113'422.77	0.08	a)
US84265VAE56	6.7500 % SCCO 6 3/4 04/16/40	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US84265VAJ44	5.8750 % SCCO 5 7/8 04/23/45	125	0	125	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US843646AH38	5.1500 % SO 5.15 09/15/41	50	0	0	50 USD	90.40%	42'365.48	0.03	a)
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US858119BM10	3.2500 % STLD 3 1/4 01/15/31	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAC47	3.7840 % SUMIBK 3.784 03/09/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAF77	2.6320 % SUMIBK 2.632 07/14/26	0	100	0	100 USD	91.25%	85'523.50	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US86562MAK62	3.0100 % SUMIBK 3.01 10/19/26	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAN02	3.4460 % SUMIBK 3.446 01/11/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAR16	3.3640 % SUMIBK 3.364 07/12/27	0	100	0	100 USD	92.76%	86'935.47	0.06	a)
US86562MBC38	3.9440 % SUMIBK 3.944 07/19/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBG42	4.3060 % SUMIBK 4.306 10/16/28	0	100	0	100 USD	94.92%	88'961.71	0.06	a)
US86562MBP41	3.0400 % SUMIBK 3.04 07/16/29	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBV19	2.3480 % SUMIBK 2.348 01/15/25	0	200	0	200 USD	94.12%	176'421.00	0.12	a)
US86562MCB46	2.1300 % SUMIBK 2.13 07/08/30	0	200	0	200 USD	79.97%	149'911.83	0.11	a)
US86787EBB20	4.0500 % TFC 4.05 11/03/25 BKNT	185	0	0	185 USD	97.60%	169'229.69	0.12	a)
US86787EBC03	3.2000 % TFC 3.2 04/01/24 BNKT	185	0	185	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US867914BS12	4.0000 % TFC 4 05/01/25	100	0	0	100 USD	97.47%	91'350.57	0.06	a)
US87165BAD55	4.2500 % SYF 4 1/4 08/15/24	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87165BAL71	3.7000 % SYF 3.7 08/04/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87165BAN38	4.3750 % SYF 4 3/8 03/19/24	185	0	185	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264AAZ84	4.5000 % TMUS 4 1/2 04/15/50	0	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABF12	3.8750 % TMUS 3 7/8 04/15/30	280	0	280	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABX28	2.2500 % TMUS 2 1/4 11/15/31	190	0	190	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	185	0	185	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060AY21	3.0250 % TACHEM 3.025 07/09/40	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060AZ95	3.1750 % TACHEM 3.175 07/09/50	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US874060BD74	3.3750 % TACHEM 3 3/8 07/09/60	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612BBQ41	5.5000 % TRGP 5 1/2 03/01/30	0	200	150	50 USD	94.63%	44'343.64	0.03	a)
US87612BBU52	4.0000 % TRGP 4 01/15/32	0	100	0	100 USD	84.75%	79'431.94	0.06	a)
US87612GAB77	4.9500 % TRGP 4.95 04/15/52	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JAJ79	6.5500 % TWC 6.55 05/01/37	50	0	0	50 USD	95.75%	44'869.81	0.03	a)
US88732JAY47	5.8750 % TWC 5 7/8 11/15/40	110	0	110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JBB35	5.5000 % TWC 5 1/2 09/01/41	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JBD90	4.5000 % TWC 4 1/2 09/15/42	120	0	0	120 USD	74.77%	84'088.98	0.06	a)
US891906AC37	4.8000 % GPN 4.8 04/01/26	100	0	0	100 USD	97.43%	91'317.30	0.06	a)
US896239AC42	4.9000 % TRMB 4.9 06/15/28	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89641UAC53	4.4000 % WTW 4.4 03/15/26	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHN35	2.3750 % USB 2 3/8 07/22/26 V	0	250	100	150 USD	91.55%	128'713.20	0.09	a)
US91159HHS22	3.9000 % USB 3.9 04/26/28 MTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HGX17	2.4000 % USB 2.4 07/30/24	0	100	0	100 USD	96.05%	90'025.49	0.06	a)
US91159HJA95	1.3750 % USB 1 3/8 07/22/30 MTN	0	100	0	100 USD	77.33%	72'475.11	0.05	a)
US91159HJD35	2.6770 % USB 2.677 01/27/33 MTN	0	100	0	100 USD	82.51%	77'336.81	0.05	a)
US913017BT50	4.5000 % RTX 4 1/2 06/01/42	65	0	0	65 USD	89.86%	54'746.58	0.04	a)
US913017CR85	3.1250 % RTX 3 1/8 05/04/27	160	0	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US913017CX53	4.6250 % RTX 4 5/8 11/16/48	200	0	100	100 USD	90.69%	85'003.70	0.06	a)
US913017CY37	4.1250 % RTX 4 1/8 11/16/28	190	0	0	190 USD	95.31%	169'734.39	0.12	a)
US91911TAH68	6.8750 % VALEBZ 6 7/8 11/21/36	0	100	0	100 USD	102.63%	96'185.28	0.07	a)
US91911TAQ67	3.7500 % VALEBZ 3 3/4 07/08/30	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91913YAE05	7.5000 % VLO 7 1/2 04/15/32	55	0	55	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US925650AB99	4.7500 % VICI 4 3/4 02/15/28	0	100	0	100 USD	94.13%	88'218.66	0.06	a)
US925650AD55	5.1250 % VICI 5 1/8 05/15/32	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US928881AF82	2.9500 % VNT 2.95 04/01/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92936UAG40	2.4000 % WPC 2.4 02/01/31	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US948596AD39	3.5000 % WB 3 1/2 07/05/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US962166BY91	4.0000 % WY 4 04/15/30	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US969457BW96	4.5500 % WMB 4.55 06/24/24	115	0	115	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96949LAB18	4.0000 % WMB 4 09/15/25	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96949LAC90	5.1000 % WMB 5.1 09/15/45	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96949LAE56	4.8500 % WMB 4.85 03/01/48	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96950FAM68	4.3000 % WMB 4.3 03/04/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96950FAP99	4.9000 % WMB 4.9 01/15/45	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US96950FAQ72	3.9000 % WMB 3.9 01/15/25	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US970648AJ01	2.9500 % WTW 2.95 09/15/29	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98978VAH69	4.7000 % ZTS 4.7 02/01/43	65	0	65	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU12246AA91	4.3750 % CTRA 4 3/8 06/01/24 REGS	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU12246AB74	3.9000 % CTRA 3.9 05/15/27 REGS	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USU4322CAB91	5.8750 % DINO 5 7/8 04/01/26 REGS	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1934286904	4.3750 % BCLMHK 4 3/8 01/22/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1958532829	4.2000 % VNKRL 4.2 06/07/24 EMTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2193950354	2.1250 % CHINLP 2 1/8 06/30/30 EMTN	200	0	0	200 USD	81.59%	152'932.96	0.11	a)
XS2201858938	1.2000 % ICBCAS 1.2 07/20/25 GMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD							11'029'195.91	7.73	

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

							121'021'377.49	84.86	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							121'021'377.49	84.86	
CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	73'834	3'650	22'690	54'793 CHF	101.27	5'549'091.41	3.89	a)
CHF							5'549'091.41	3.89	
CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	421'459	108'315	213'407	316'367 EUR	112.79	35'468'469.65	24.87	a)
EUR							35'468'469.65	24.87	
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	916'938	198'013	420'121	694'830 USD	122.85	80'003'816.43	56.10	a)
USD							80'003'816.43	56.10	

Derivative Finanzinstrumente

							0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF	Verfall	06.07.2022	115'573	120'000	CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall	06.07.2022	100'092	100'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD	Verfall	03.08.2022	254'893	250'000	USD/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF	Verfall	29.12.2022	102'318	110'000	CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall	29.12.2022	69'029	70'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'155'304.72	2.21
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	17'707'075.60	12.42
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	121'021'377.49	84.86
Sonstige Vermögenswerte	732'394.82	0.51
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	142'616'152.63	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-810.86	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	142'615'341.77	

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);	138'728'453.09	97.27
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.99395514
USD	1 = CHF	0.93725000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.435	0.00 - 0.25	-	0.015
MT CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.435	0.00 - 0.25	-	0.015
NT CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.435	0.00 - 0.25	-	0.015
XT CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.435	0.00 - 0.25	-	0.015

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

6 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	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 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: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	3.000
MT CHF	-	-	-	-	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
XT CHF	0.310	0.500	0.210	0.100	3.000

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.

8 Benchmark

FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index

9 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.

10 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	3.452	1.208	2.244
MT CHF	Nein	CHF	2.768	0.968	1.800
NT CHF	Nein	CHF	3.756	1.314	2.442
XT CHF	Nein	CHF	2.756	0.964	1.792

11 Fussnoten

- 1) Der 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.
- 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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen

(Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anleger
des
Swisscanto (CH) Index Fund I
ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger
(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF
(nachfolgend „die Teilvermögen“)

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

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

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

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

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

1. Umbenennung von Anteilsklassen

Die bestehenden Anteilsklassen mit Währungsabsicherung werden wie folgt umbenannt (vgl. § 6 Ziff. 4 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages):

Bisherige Anteilsklassenbezeichnung	Neue Anteilsklassenbezeichnung
XTH CHF	XTH1 CHF
XTH EUR	XTH1 EUR
XTH GBP	XTH1 GBP
XTH USD	XTH1 USD

XAH CHF	XAH1 CHF
XAH EUR	XAH1 EUR
XAH GBP	XAH1 GBP
XAH USD	XAH1 USD
STH CHF	STH1 CHF
STH EUR	STH1 EUR
STH GBP	STH1 GBP
STH USD	STH1 USD
SAH CHF	SAH1 CHF
SAH EUR	SAH1 EUR
SAH GBP	SAH1 GBP
SAH USD	SAH1 USD
DTH CHF	DTH1 CHF
DTH EUR	DTH1 EUR
DTH GBP	DTH1 GBP
DTH USD	DTH1 USD
DAH CHF	DAH1 CHF
DAH EUR	DAH1 EUR
DAH GBP	DAH1 GBP
DAH USD	DAH1 USD
GTH CHF	GTH1 CHF
GTH EUR	GTH1 EUR
GTH GBP	GTH1 GBP
GTH USD	GTH1 USD
GAH CHF	GAH1 CHF
GAH EUR	GAH1 EUR
GAH GBP	GAH1 GBP
GAH USD	GAH1 USD

MTH CHF	MTH1 CHF
MTH EUR	MTH1 EUR
MTH GBP	MTH1 GBP
MTH USD	MTH1 USD
MAH CHF	MAH1 CHF
MAH EUR	MAH1 EUR
MAH GBP	MAH1 GBP
MAH USD	MAH1 USD
NTH CHF	NTH1 CHF
NTH EUR	NTH1 EUR
NTH GBP	NTH1 GBP
NTH USD	NTH1 USD
NAH CHF	NAH1 CHF
NAH EUR	NAH1 EUR
NAH GBP	NAH1 GBP
NAH USD	NAH1 USD

2. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 11 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

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

3. Keine Regelung der Umwandlung mehr

Bisher wurde in § 25 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 25 des Fondsvertrages und in § 25 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 und Ziff. 2 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

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

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 3 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

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

Zürich, 29. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich