

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE VV CHF

## Jahresbericht per 31.05.2023

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Investment Solutions Fund  
Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
GT CHF	38111100	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Zürich, 28. September 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

### Swisscanto (CH) Investment Solutions Fund, Zürich

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Solutions Fund,

mit dem Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible VV CHF

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Mai 2023, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung“ 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 Jahresrechnung**

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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 Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung 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**

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Mai 2023, der Erfolgsrechnung 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	14
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	14
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
8	Pauschale Verwaltungskommission	15
9	Benchmark	15
10	TER	15
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	16
12	Fussnoten	16
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17
14	Pflichtpublikationen	19

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.06.2022	01.06.2021	01.06.2020	01.06.2019
	bis	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021	31.05.2020
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		935'420'884.97	798'338'876.55	948'150'343.24	1'067'157'455.89
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		935'420'884.97	798'338'876.55	948'150'343.24	1'067'157'455.89
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'170'117.029	8'624'346.202	9'274'621.377	10'426'884.127
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		91.9774	92.5680	102.2306	102.3467
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.2993	92.7532	102.4555	102.0397
Thesaurierung je Anteil		0.58	0.46	0.51	0.58
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %

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 GT CHF	-0.46 %	-12.39 %	-1.80 %	1.03 %

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

### Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.05.2023	31.05.2022
Bankguthaben auf Sicht	833'534.27	400'000.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	928'610'294.75	806'517'648.70
Derivative Finanzinstrumente	548'305.90	-438'923.20
Sonstige Vermögenswerte	5'596'517.56	3'491'585.65
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>935'588'652.48</b>	<b>809'970'311.15</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-11'489'912.88
Andere Verbindlichkeiten	-167'767.51	-141'521.72
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>935'420'884.97</b>	<b>798'338'876.55</b>

### Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse GT CHF	von	01.06.2022	01.06.2021
	bis	31.05.2023	31.05.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'624'346.202	9'274'621.377
Ausgegebene Anteile		4'450'465.977	2'183'036.186
Zurückgenommene Anteile		-2'904'695.150	-2'833'311.361
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>10'170'117.029</b>	<b>8'624'346.202</b>



## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		798'338'876.55	948'150'343.24
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'819'794.56	-1'737'109.92
Saldo aus dem Anteilverkehr		144'136'693.03	-63'745'564.30
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-5'234'890.05	-84'328'792.47
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>935'420'884.97</b>	<b>798'338'876.55</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.06.2022 31.05.2023	01.06.2021 31.05.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		882.36	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-16'741.15	-88'748.45
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		7'955'934.58	6'119'807.58
Erträge aus Wertpapierleihe		143'146.55	87'585.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		632'535.71	462'499.37
<b>Total Ertrag</b>		<b>8'715'758.05</b>	<b>6'581'144.25</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-426.58	-3'407.14
Reglementarische Vergütungen		-1'913'134.47	-1'849'786.96
Sonstige Aufwendungen		-412.68	-427.40
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-863'485.63	-736'699.68
<b>Total Aufwand</b>		<b>-2'777'459.36</b>	<b>-2'590'321.18</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>5'938'298.69</b>	<b>3'990'823.07</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-21'001'090.87	-9'677'579.81
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		1'427'274.39	521'365.58
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-13'635'517.79</b>	<b>-5'165'391.16</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		8'400'627.74	-79'163'401.31
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-5'234'890.05</b>	<b>-84'328'792.47</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse GT CHF	31.05.2023	31.05.2022
Nettoertrag	5'938'298.69	3'990'823.07
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>5'938'298.69</b>	<b>3'990'823.07</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'078'404.54	1'396'788.07
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'859'894.15	2'594'035.00
<b>Total</b>	<b>5'938'298.69</b>	<b>3'990'823.07</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>928'610'294.75</b>	<b>99.25</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>928'610'294.75</b>	<b>99.25</b>	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	5'200	0	200	5'000 CHF	168.25%	8'412'500.00	0.90	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	8'000	0	3'000	5'000 CHF	118.74%	5'937'000.00	0.63	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	4'000	0	0	4'000 CHF	109.65%	4'386'000.00	0.47	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	5'000	0	1'000	4'000 CHF	103.80%	4'152'000.00	0.44	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	0	4'000	3'000	1'000 CHF	102.06%	1'020'600.00	0.11	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	0	6'500	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	0	10'000	1'000	9'000 CHF	111.02%	9'991'800.00	1.07	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	9'000	0	6'500	2'500 CHF	103.68%	2'592'000.00	0.28	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	0	4'000	2'000	2'000 CHF	103.47%	2'069'400.00	0.22	a)
CH0130501304	2.7500 % KWLILI 2 3/4 06/09/23	0	6'000	0	6'000 CHF	100.02%	6'001'200.00	0.64	a)
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	1'370	0	0	1'370 CHF	103.50%	1'417'950.00	0.15	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.11	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	5'000	0	0	5'000 CHF	100.05%	5'002'500.00	0.53	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	2'540	0	0	2'540 CHF	98.65%	2'505'710.00	0.27	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'960	0	0	1'960 CHF	99.05%	1'941'380.00	0.21	a)
CH0188295312	3.5000 % CLNVX 3 1/2 09/26/22	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	0	5'000	0	5'000 CHF	97.60%	4'880'000.00	0.52	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	2'500	0	0	2'500 CHF	100.80%	2'520'000.00	0.27	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	2'500	0	0	2'500 CHF	99.16%	2'479'000.00	0.26	a)
CH0212184037	4.5325 % ALPHSW FLOAT PERP	6'615	0	0	6'615 CHF	93.80%	6'204'870.00	0.66	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'000	0	0	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.11	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	4'500	0	0	4'500 CHF	140.00%	6'300'000.00	0.67	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	3'500	0	0	3'500 CHF	91.00%	3'185'000.00	0.34	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	1'000	0	0	1'000 CHF	100.24%	1'002'400.00	0.11	a)
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	0	3'000	0	3'000 CHF	97.55%	2'926'500.00	0.31	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	95.70%	957'000.00	0.10	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	9'000	0	4'000	5'000 CHF	94.27%	4'713'500.00	0.50	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	4'000	2'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'500	0	0	1'500 CHF	96.95%	1'454'250.00	0.16	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	4'000	0	0	4'000 CHF	97.05%	3'882'000.00	0.41	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	2'000	0	0	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.21	a)
CH0284415681	0.5500 % NDASS 0.55 06/23/25 EMTN	0	5'000	3'000	2'000 CHF	97.20%	1'944'000.00	0.21	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	5'000	0	0	5'000 CHF	87.88%	4'394'000.00	0.47	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	5'000	0	0	5'000 CHF	96.55%	4'827'500.00	0.52	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	1'960	0	1'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	3'920	1'500	500	4'920 CHF	96.83%	4'764'036.00	0.51	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	5'000	0	0	5'000 CHF	92.35%	4'617'500.00	0.49	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	7'500	0	0	7'500 CHF	92.99%	6'974'250.00	0.75	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	2'000	0	0	2'000 CHF	95.70%	1'914'000.00	0.20	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	2'940	0	0	2'940 CHF	99.75%	2'932'650.00	0.31	a)
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	6'000	7'500	0	13'500 CHF	86.01%	11'611'350.00	1.24	a)
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	3'900	0	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403702	1.5000 % KWLLI 1 1/2 12/06/22	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	1'500	0	0	1'500 CHF	94.47%	1'417'050.00	0.15	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	5'000	0	0	5'000 CHF	85.12%	4'256'000.00	0.45	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	3'000	0	0	3'000 CHF	78.70%	2'361'000.00	0.25	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'570	0	0	1'570 CHF	92.70%	1'455'390.00	0.16	a)
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	99.25%	2'729'375.00	0.29	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	3'000	0	0	3'000 CHF	94.10%	2'823'000.00	0.30	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	3'500	0	0	3'500 CHF	94.45%	3'305'750.00	0.35	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	4'500	0	0	4'500 CHF	80.95%	3'642'750.00	0.39	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	1'000	0	0	1'000 CHF	88.20%	882'000.00	0.09	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	3'000	0	0	3'000 CHF	87.35%	2'620'500.00	0.28	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	16'000	0	11'000	5'000 CHF	96.81%	4'840'500.00	0.52	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	0	7'000	2'000	5'000 CHF	85.65%	4'282'500.00	0.46	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	5'000	0	0	5'000 CHF	89.68%	4'484'000.00	0.48	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	5'000	0	2'000	3'000 CHF	92.61%	2'778'300.00	0.30	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	6'000	4'000	0	10'000 CHF	85.60%	8'560'000.00	0.91	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	3'000	0	0	3'000 CHF	96.00%	2'880'000.00	0.31	a)
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP	3'000	0	0	3'000 CHF	97.75%	2'932'500.00	0.31	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	3'000	0	0	3'000 CHF	98.95%	2'968'500.00	0.32	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	0	3'000	0	3'000 CHF	88.50%	2'655'000.00	0.28	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'960	0	0	1'960 CHF	95.55%	1'872'780.00	0.20	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.60%	1'912'000.00	0.20	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	10'000	0	7'000	3'000 CHF	94.22%	2'826'600.00	0.30	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	5'000	0	0	5'000 CHF	90.25%	4'512'500.00	0.48	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	8'000	0	0	8'000 CHF	97.15%	7'772'000.00	0.83	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	2'500	0	0	2'500 CHF	92.35%	2'308'750.00	0.25	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	4'000	0	0	4'000 CHF	93.70%	3'748'000.00	0.40	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	7'000	0	2'000	5'000 CHF	90.26%	4'513'000.00	0.48	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379611004	2.2000 % BALHOL 2.2 06/19/48	2'800	0	0	2'800 CHF	93.10%	2'606'800.00	0.28	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	4'250	0	2'000	2'250 CHF	95.39%	2'146'275.00	0.23	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	3'000	0	0	3'000 CHF	96.50%	2'895'000.00	0.31	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'000	0	0	2'000 CHF	93.40%	1'868'000.00	0.20	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	2'000	0	0	2'000 CHF	93.00%	1'860'000.00	0.20	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	3'000	0	0	3'000 CHF	92.55%	2'776'500.00	0.30	a)
CH0399198396	0.6250 % DB 0 5/8 02/08/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	5'000	0	0	5'000 CHF	89.55%	4'477'500.00	0.48	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LANSBK 0.2 04/17/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	95.30%	4'765'000.00	0.51	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.05%	1'941'000.00	0.21	a)
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	4'000	0	0	4'000 CHF	98.57%	3'942'800.00	0.42	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	96.65%	3'866'000.00	0.41	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0418609613	0.5650 % MBKPW 0.565 06/07/22 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	0	7'500	0	7'500 CHF	91.70%	6'877'500.00	0.74	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	5'000	4'000	4'000	5'000 CHF	92.20%	4'610'000.00	0.49	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	1'500	3'500	0	5'000 CHF	90.94%	4'547'000.00	0.49	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	2'500	0	0	2'500 CHF	93.45%	2'336'250.00	0.25	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'700	0	0	2'700 CHF	89.10%	2'405'700.00	0.26	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	3'000	0	0	3'000 CHF	71.25%	2'137'500.00	0.23	a)
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042566	2.6250 % VONTOB 2 5/8 PERP	3'000	0	0	3'000 CHF	93.85%	2'815'500.00	0.30	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	2'500	0	0	2'500 CHF	93.60%	2'340'000.00	0.25	a)
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	5'000	0	3'000	2'000 CHF	99.02%	1'980'400.00	0.21	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	6'000	0	1'000	5'000 CHF	90.47%	4'523'500.00	0.48	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	0	3'500	0	3'500 CHF	85.96%	3'008'600.00	0.32	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	96.05%	4'802'500.00	0.51	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	2'500	0	0	2'500 CHF	95.45%	2'386'250.00	0.26	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	6'200	3'800	0	10'000 CHF	98.74%	9'874'000.00	1.06	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	2'600	0	0	2'600 CHF	91.45%	2'377'700.00	0.25	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	4'500	0	0	4'500 CHF	83.85%	3'773'250.00	0.40	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	5'000	0	0	5'000 CHF	80.65%	4'032'500.00	0.43	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.60%	2'898'000.00	0.31	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	0	4'000	0	4'000 CHF	87.15%	3'486'000.00	0.37	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	2'650	0	0	2'650 CHF	98.78%	2'617'670.00	0.28	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	98.97%	1'385'580.00	0.15	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	97.32%	3'892'800.00	0.42	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	5'000	0	0	5'000 CHF	94.50%	4'725'000.00	0.51	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	0	5'000	0	5'000 CHF	90.39%	4'519'500.00	0.48	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	2'500	0	0	2'500 CHF	96.00%	2'400'000.00	0.26	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.55%	955'500.00	0.10	a)
CH0479514223	0.0400 % SWICC 2019-1 A	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.35%	1'847'000.00	0.20	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.95%	949'500.00	0.10	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	5'000	0	0	5'000 CHF	93.35%	4'667'500.00	0.50	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	3'500	0	0	3'500 CHF	64.60%	2'261'000.00	0.24	a)
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	5'000	0	0	5'000 CHF	78.70%	3'935'000.00	0.42	a)
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	87.00%	3'480'000.00	0.37	a)
CH0488506699	0.1250 % NWG 0 1/8 09/13/23 EMTN	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734384	3.0000 % CS 3 PERP	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	2'000	0	0	2'000 CHF	55.20%	1'104'000.00	0.12	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	2'000	0	0	2'000 CHF	90.50%	1'810'000.00	0.19	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	5'000	0	0	5'000 CHF	95.20%	4'760'000.00	0.51	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	7'000	0	2'000	5'000 CHF	87.10%	4'355'000.00	0.47	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	0	5'000	0	5'000 CHF	82.85%	4'142'500.00	0.44	a)
CH0520663581	0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	95.50%	7'640'000.00	0.82	a)
CH0520663599	0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	85.05%	6'378'750.00	0.68	a)
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 CHF	92.70%	3'708'000.00	0.40	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	88.25%	4'412'500.00	0.47	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	0	8'000	0	8'000 CHF	95.70%	7'656'000.00	0.82	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	4'250	0	0	4'250 CHF	96.95%	4'120'375.00	0.44	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	7'000	0	0	7'000 CHF	92.35%	6'464'500.00	0.69	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	84.70%	1'694'000.00	0.18	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	2'600	0	0	2'600 CHF	96.60%	2'511'600.00	0.27	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	0	10'000	0	10'000 CHF	91.85%	9'185'000.00	0.98	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	9'500	0	0	9'500 CHF	93.57%	8'889'150.00	0.95	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'000	5'000	1'000	6'000 CHF	96.90%	5'814'000.00	0.62	a)
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	2'500	0	0	2'500 CHF	90.20%	2'255'000.00	0.24	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	0	2'000	0	2'000 CHF	92.20%	1'844'000.00	0.20	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	4'500	0	0	4'500 CHF	90.70%	4'081'500.00	0.44	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	96.75%	4'837'500.00	0.52	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'000	0	0	3'000 CHF	97.30%	2'919'000.00	0.31	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'000	0	0	5'000 CHF	89.12%	4'456'000.00	0.48	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778658	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 DEC	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	89.85%	4'492'500.00	0.48	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	5'500	0	0	5'500 CHF	90.50%	4'977'500.00	0.53	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	0	1'750	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	3'000	0	0	3'000 CHF	83.65%	2'509'500.00	0.27	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	0	3'500	1'000	2'500 CHF	86.20%	2'155'000.00	0.23	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'000	0	0	1'000 CHF	91.95%	919'500.00	0.10	a)
CH0572142468	1.2500 % SYNNVX 1 1/4 10/16/23	5'000	0	0	5'000 CHF	99.61%	4'980'500.00	0.53	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	10'000	0	0	10'000 CHF	84.07%	8'407'000.00	0.90	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017014	0.6250 % SWMOB 2020-2 A	3'000	0	0	3'000 CHF	99.16%	2'974'776.00	0.32	a)
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 CHF	89.55%	3'582'000.00	0.38	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	2'000	3'000	0	5'000 CHF	80.15%	4'007'500.00	0.43	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	5'000	0	0	5'000 CHF	83.30%	4'165'000.00	0.45	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	5'000	0	0	5'000 CHF	90.73%	4'536'500.00	0.48	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	0	10'000	0	10'000 CHF	71.38%	7'138'000.00	0.76	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	3'750	0	0	3'750 CHF	92.00%	3'450'000.00	0.37	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	2'000	0	1'600	400 CHF	92.05%	368'200.00	0.04	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	2'000	0	2'000 CHF	87.60%	1'752'000.00	0.19	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	3'700	0	0	3'700 CHF	85.35%	3'157'950.00	0.34	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	5'000	0	0	5'000 CHF	88.14%	4'407'000.00	0.47	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	87.50%	7'000'000.00	0.75	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	10'000	0	5'000	5'000 CHF	92.16%	4'608'000.00	0.49	a)
CH1101825797	2.2500 % RAIFFS 2 1/4 PERP	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	3'750	0	0	3'750 CHF	98.31%	3'686'493.75	0.39	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	92.50%	2'405'000.00	0.26	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	3'000	2'000	0	5'000 CHF	91.30%	4'565'000.00	0.49	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'500	0	0	2'500 CHF	88.65%	2'216'250.00	0.24	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	1'700	0	0	1'700 CHF	83.80%	1'424'600.00	0.15	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	4'000	0	0	4'000 CHF	76.45%	3'058'000.00	0.33	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	84.95%	3'398'000.00	0.36	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	5'000	0	0	5'000 CHF	85.75%	4'287'500.00	0.46	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	85.00%	2'550'000.00	0.27	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	91.60%	4'580'000.00	0.49	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	87.35%	3'494'000.00	0.37	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	5'000	0	2'000	3'000 CHF	86.65%	2'599'500.00	0.28	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'000	4'000	1'000	5'000 CHF	78.11%	3'905'500.00	0.42	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	1'800	0	0	1'800 CHF	88.40%	1'591'200.00	0.17	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'850	0	0	1'850 CHF	86.70%	1'603'950.00	0.17	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	1'500	0	0	1'500 CHF	84.70%	1'270'500.00	0.14	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	88.70%	2'306'200.00	0.25	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	88.60%	2'658'000.00	0.28	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	88.25%	2'647'500.00	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'650	0	650	1'000 CHF	95.65%	956'500.00	0.10	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	88.80%	4'440'000.00	0.47	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	89.75%	3'590'000.00	0.38	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	4'900	0	0	4'900 CHF	96.20%	4'713'800.00	0.50	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	91.75%	4'587'500.00	0.49	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	91.90%	4'595'000.00	0.49	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.05%	1'801'000.00	0.19	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	91.50%	4'575'000.00	0.49	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	85.90%	4'295'000.00	0.46	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	3'000	0	2'000	1'000 CHF	89.85%	898'500.00	0.10	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	89.25%	4'462'500.00	0.48	a)
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	1'000	0	0	1'000 CHF	90.15%	901'500.00	0.10	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'000	0	0	2'000 CHF	84.30%	1'686'000.00	0.18	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	2'500	0	0	2'500 CHF	94.53%	2'363'250.00	0.25	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	4'000	0	0	4'000 CHF	86.45%	3'458'000.00	0.37	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	7'000	0	0	7'000 CHF	86.95%	6'086'500.00	0.65	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	5'000	0	0	5'000 CHF	82.00%	4'100'000.00	0.44	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	5'000	2'000	0	7'000 CHF	93.60%	6'552'000.00	0.70	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	88.90%	4'445'000.00	0.48	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	5'000	3'000	2'000 CHF	90.45%	1'809'000.00	0.19	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'300	0	0	1'300 CHF	96.90%	1'259'700.00	0.13	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	5'000	0	0	5'000 CHF	95.90%	4'795'000.00	0.51	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	10'000	0	0	10'000 CHF	91.71%	9'171'000.00	0.98	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	95.30%	6'671'000.00	0.71	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	3'000	2'000	0	5'000 CHF	95.10%	4'755'000.00	0.51	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	7'000	0	2'000	5'000 CHF	94.89%	4'744'500.00	0.51	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	0	2'000	0	2'000 CHF	94.70%	1'894'000.00	0.20	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	94.80%	2'844'000.00	0.30	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	95.70%	2'871'000.00	0.31	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	0	2'500	0	2'500 CHF	96.95%	2'423'750.00	0.26	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.21	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	96.75%	4'837'500.00	0.52	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	95.75%	4'787'500.00	0.51	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	0	10'000	0	10'000 CHF	98.65%	9'865'000.00	1.05	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	4'500	0	500	4'000 CHF	97.75%	3'910'000.00	0.42	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	0	5'000	0	5'000 CHF	98.65%	4'932'500.00	0.53	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	0	5'000	0	5'000 CHF	100.80%	5'040'000.00	0.54	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	0	15'000	5'000	10'000 CHF	99.27%	9'927'000.00	1.06	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	0	4'250	4'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	4'000	1'000	0	5'000 CHF	98.05%	4'902'500.00	0.52	a)
CH1194000316	1.8100 % NDASS 1.81 06/15/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	97.85%	4'892'500.00	0.52	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.20%	4'960'000.00	0.53	a)
CH1194355041	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 JUL	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	0	5'000	0	5'000 CHF	102.76%	5'138'000.00	0.55	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	0	7'500	0	7'500 CHF	112.29%	8'421'750.00	0.90	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27	0	4'000	0	4'000 CHF	99.45%	3'978'000.00	0.43	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	1'700	0	1'700 CHF	102.90%	1'749'300.00	0.19	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	0	2'650	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	0	5'000	0	5'000 CHF	97.80%	4'890'000.00	0.52	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	0	4'000	400	3'600 CHF	103.10%	3'711'600.00	0.40	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.54	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	0	3'500	0	3'500 CHF	99.35%	3'477'250.00	0.37	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	0	5'000	0	5'000 CHF	101.80%	5'090'000.00	0.54	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.35%	1'987'000.00	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	0	3'000	0	3'000 CHF	99.35%	2'980'500.00	0.32	a)
CH1214797123	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 SEP	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	1'750	0	1'750 CHF	101.80%	1'781'500.00	0.19	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	102.05%	3'571'750.00	0.38	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	0	5'000	0	5'000 CHF	104.45%	5'222'500.00	0.56	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	0	5'000	0	5'000 CHF	105.30%	5'265'000.00	0.56	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.90%	4'995'000.00	0.53	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	0	3'000	0	3'000 CHF	99.35%	2'980'500.00	0.32	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.15%	3'034'500.00	0.32	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	0	3'000	0	3'000 CHF	101.30%	3'039'000.00	0.32	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	5'000	0	5'000 CHF	100.70%	5'035'000.00	0.54	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	0	10'000	6'000	4'000 CHF	99.15%	3'966'000.00	0.42	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	2'200	0	2'200 CHF	102.90%	2'263'800.00	0.24	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	5'000	0	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.54	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	2'600	0	2'600 CHF	101.30%	2'633'800.00	0.28	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	98.00%	4'900'000.00	0.52	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	0	3'000	0	3'000 CHF	99.90%	2'997'000.00	0.32	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	98.10%	5'886'000.00	0.63	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	100.79%	2'015'780.00	0.22	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	3'000	0	3'000 CHF	101.90%	3'057'000.00	0.33	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	3'000	0	3'000 CHF	100.10%	3'003'030.00	0.32	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	3'000	0	3'000 CHF	101.05%	3'031'500.00	0.32	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	5'000	0	5'000 CHF	103.07%	5'153'500.00	0.55	a)
CH1264823514	2.4900 % NDASS 2.49 05/26/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.80%	3'024'000.00	0.32	a)
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	2'000	0	2'000 CHF	107.09%	2'141'800.00	0.23	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	99.99%	2'999'760.00	0.32	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.53%	3'015'780.00	0.32	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.61%	3'018'390.00	0.32	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	100.49%	1'205'844.00	0.13	a)
<b>CHF</b>							<b>928'610'294.75</b>	<b>99.25</b>	

**Derivative Finanzinstrumente**
**548'305.90 0.06**
**Swaps**
**548'305.90 0.06**

01/27	IRS FIX LEG -0.1125% P.A. CHF	11'000	0	6'000	5'000 CHF	93.05%	4'652'541.65	0.50	b)
01/27	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	-11'000	6'000	0	-5'000 CHF	100.00	-5'000'000.00	-0.53	b)
01/30	IRS FIX LEG 1.5425% P.A. CHF	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/30	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/30	IRS FIX LEG 1.965% P.A. CHF	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
03/30	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	20'000	20'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
05/30	IRS FIX LEG 1.85% P.A. CHF	0	15'000	0	15'000 CHF	100.86%	15'128'441.25	1.62	b)
05/30	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	0	15'000	-15'000 CHF	100.00	-15'000'000.00	-1.60	b)
05/37	IRS FIX LEG 1.515% P.A. CHF	-3'000	3'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
05/37	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
07/37	IRS FIX LEG 1.84% P.A. CHF	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
07/37	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
10/38	IRS FIX LEG 1.682% P.A. CHF	0	0	15'000	-15'000 CHF	97.79%	-14'668'174.65	-1.57	b)
10/38	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	1.60	b)
04/42	IRS FIX LEG 1.6685% P.A. CHF	0	0	15'000	-15'000 CHF	96.79%	-14'518'547.85	-1.55	b)
04/42	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	1.60	b)
06/45	IRS FIX LEG 1.8525% P.A. CHF	0	5'000	15'000	-10'000 CHF	100.46%	-10'045'954.50	-1.07	b)
06/45	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	0	15'000	5'000	10'000 CHF	100.00	10'000'000.00	1.07	b)

**Vermögensaufstellung**
**Kurswert CHF in % 7)**

Bankguthaben auf Sicht	833'534.27	0.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	928'610'294.75	99.25
Derivative Finanzinstrumente	548'305.90	0.06
Sonstige Vermögenswerte	5'596'517.56	0.60
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>935'588'652.48</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-167'767.51	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>935'420'884.97</b>	

**Bewertungskategorien**
**Kurswert CHF in % 7)**

a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	928'610'294.75	99.25
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	548'305.90	0.06
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**
**181'279'829.10 19.38**
**Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte**
**181'279'829.10 19.38**

CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	4'992 CHF	168.25%	8'399'040.00	0.90
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	5'000 CHF	118.74%	5'937'000.00	0.63
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	3'485 CHF	109.65%	3'821'302.50	0.41
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	9'000 CHF	111.02%	9'991'800.00	1.07
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	842 CHF	103.68%	872'985.60	0.09
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'500 CHF	98.65%	1'479'750.00	0.16
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'500 CHF	100.80%	1'512'000.00	0.16
CH0212184037	4.5325 % ALPHSW FLOAT PERP	450 CHF	93.80%	422'100.00	0.05
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	4'500 CHF	140.00%	6'300'000.00	0.67
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	500 CHF	91.00%	455'000.00	0.05
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	500 CHF	97.25%	486'250.00	0.05
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	1'500 CHF	87.88%	1'318'200.00	0.14
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	500 CHF	96.55%	482'750.00	0.05
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	5'155 CHF	92.99%	4'793'634.50	0.51
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	1'595 CHF	86.01%	1'371'859.50	0.15
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	400 CHF	78.70%	314'800.00	0.03
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	500 CHF	94.10%	470'500.00	0.05



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.05.2023 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	4'000 CHF	80.95%	3'238'000.00	0.35	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	3'000 CHF	87.35%	2'620'500.00	0.28	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	5'000 CHF	96.81%	4'840'500.00	0.52	
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	5'000 CHF	89.68%	4'484'000.00	0.48	
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP	400 CHF	97.75%	391'000.00	0.04	
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	2'500 CHF	98.95%	2'473'750.00	0.26	
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	500 CHF	88.50%	442'500.00	0.05	
CH0379611004	2.2000 % BALHOL 2.2 06/19/48	2'090 CHF	93.10%	1'945'790.00	0.21	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	500 CHF	96.65%	483'250.00	0.05	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	4'000 CHF	91.70%	3'668'000.00	0.39	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	2'500 CHF	93.45%	2'336'250.00	0.25	
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'000 CHF	71.25%	712'500.00	0.08	
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'000 CHF	99.02%	1'980'400.00	0.21	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	5'000 CHF	90.47%	4'523'500.00	0.48	
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	3'500 CHF	85.96%	3'008'600.00	0.32	
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	500 CHF	95.45%	477'250.00	0.05	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	500 CHF	80.65%	403'250.00	0.04	
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	3'000 CHF	94.50%	2'835'000.00	0.30	
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	2'500 CHF	96.00%	2'400'000.00	0.26	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	750 CHF	94.95%	712'125.00	0.08	
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'000 CHF	87.00%	870'000.00	0.09	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	5'000 CHF	87.10%	4'355'000.00	0.47	
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	3'000 CHF	82.85%	2'485'500.00	0.27	
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	440 CHF	92.70%	407'880.00	0.04	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	1'000 CHF	95.70%	957'000.00	0.10	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	4'000 CHF	92.35%	3'694'000.00	0.39	
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	2'600 CHF	96.60%	2'511'600.00	0.27	
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	1'500 CHF	93.57%	1'403'550.00	0.15	
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	1'000 CHF	96.75%	967'500.00	0.10	
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	2'000 CHF	89.12%	1'782'400.00	0.19	
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	295 CHF	83.65%	246'767.50	0.03	
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'000 CHF	91.95%	919'500.00	0.10	
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	500 CHF	84.07%	420'350.00	0.04	
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	4'000 CHF	89.55%	3'582'000.00	0.38	
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	1'500 CHF	83.30%	1'249'500.00	0.13	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	3'500 CHF	92.00%	3'220'000.00	0.34	
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	1'600 CHF	87.60%	1'401'600.00	0.15	
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	2'500 CHF	85.35%	2'133'750.00	0.23	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	1'130 CHF	88.14%	995'982.00	0.11	
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'000 CHF	87.50%	1'750'000.00	0.19	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	1'000 CHF	84.95%	849'500.00	0.09	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	1'500 CHF	85.00%	1'275'000.00	0.14	
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	500 CHF	88.60%	443'000.00	0.05	
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	500 CHF	88.25%	441'250.00	0.05	
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	2'500 CHF	89.75%	2'243'750.00	0.24	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'500 CHF	91.75%	1'376'250.00	0.15	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	2'000 CHF	91.90%	1'838'000.00	0.20	
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'000 CHF	90.05%	900'500.00	0.10	
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	1'800 CHF	91.50%	1'647'000.00	0.18	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	3'000 CHF	85.90%	2'577'000.00	0.28	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	500 CHF	90.15%	450'750.00	0.05	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000 CHF	84.30%	843'000.00	0.09	
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	200 CHF	88.90%	177'800.00	0.02	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	3'730 CHF	95.90%	3'577'070.00	0.38	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	6'200 CHF	91.71%	5'686'020.00	0.61	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'500 CHF	96.75%	2'418'750.00	0.26	
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	2'500 CHF	98.65%	2'466'250.00	0.26	
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	3'000 CHF	99.27%	2'978'100.00	0.32	
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	3'000 CHF	102.76%	3'082'800.00	0.33	
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	3'525 CHF	112.29%	3'958'222.50	0.42	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.05.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	1'700 CHF	102.90%	1'749'300.00	0.19	
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	500 CHF	101.80%	509'000.00	0.05	
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	500 CHF	104.45%	522'250.00	0.06	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	500 CHF	99.90%	499'500.00	0.05	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'000 CHF	99.35%	1'987'000.00	0.21	
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	500 CHF	99.15%	495'750.00	0.05	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	5'000 CHF	101.20%	5'060'000.00	0.54	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	1'500 CHF	98.00%	1'470'000.00	0.16	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	2'000 CHF	99.90%	1'998'000.00	0.21	

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	36'137'464.85	18.382
Bond	CHF	160'434'800.90	81.607
Equity	CHF	23'133.51	0.012
Total	CHF	196'595'399.26	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	59'013'659.90	6.309
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	10'743'236.58	1.148
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

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

Periode: 01.06.2022 - 31.05.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten (30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten (30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
GT 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	181'279'829.10
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.06.2022 - 31.05.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
GT CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	4.000

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

## 9 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 19.09.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.09.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT CHF	Nein	CHF	0.58389	0.20436	0.37953

## 12 Fussnoten

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

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

In den in § 18 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zuflussenden 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 des Teilvermögens, getätigt wurden.

## **Mitteilung an die Anleger**

des

### **Swisscanto (CH) Investment Solutions Fund**

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

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit dem Teilvermögen

### **Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible VV CHF**

(nachfolgend „das 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 erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 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. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift**

§ 15 Ziff. 8 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

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

#### **2. 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<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages 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. 1 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger 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