

GKB (CH) OBLIGATIONEN CHF ESG

Jahresbericht per 31.01.2024

Teilvermögen des GKB (CH)

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

Klasse	Valor	Währung
A	30694189	CHF
B	30694304	CHF
I	30694309	CHF
N	30695344	CHF
V	58849318	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 30.05.2024

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

GKB (CH),

mit den Teilvermögen

- ▶ GKB (CH) Obligationen CHF ESG
- ▶ GKB (CH) Aktien Schweiz ESG
- ▶ GKB (CH) Aktien Welt ESG
- ▶ GKB (CH) Vorsorgefonds 25 ESG
- ▶ GKB (CH) Vorsorgefonds 45 ESG
- ▶ GKB (CH) Strategiefonds Einkommen ESG
- ▶ GKB (CH) Strategiefonds Ausgewogen ESG
- ▶ GKB (CH) Strategiefonds Wachstum ESG
- ▶ GKB (CH) Strategiefonds Kapitalgewinn ESG

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	14
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
7	Pauschale Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	16
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	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
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 Graubündner Kantonalbank, Grabenstrasse/Poststrasse, 7000 Chur
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

Graubündner Kantonalbank, Grabenstrasse/Poststrasse, 7000 Chur

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		671'971'282.53	615'850'047.84	648'766'920.55	519'734'930.69
Klasse A					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'694'715.55	9'065'050.43	9'688'411.57	11'076'779.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		117'561.797	103'906.658	101'805.531	112'783.037
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.97	87.24	95.17	98.21
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.29	86.96	95.24	98.05
Ausschüttung je Anteil		0.20	-	-	0.40
Total Expense Ratio (TER)		0.70 %	0.70 %	0.70 %	0.73 %
Klasse B					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'624'487.61	13'103'217.37	11'906'159.17	11'427'033.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		161'031.580	150'326.787	125'408.571	116'801.743
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.82	87.16	94.94	97.83
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.14	86.89	95.01	97.67
Ausschüttung je Anteil		0.25	0.20	-	0.40
Total Expense Ratio (TER)		0.55 %	0.55 %	0.55 %	0.58 %
Klasse I					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		314'006'091.62	310'630'321.15	332'239'237.93	266'566'840.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'356'257.002	3'469'505.219	3'408'774.904	2'664'637.568
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.56	89.53	97.47	100.04
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		93.89	89.25	97.54	99.87
Thesaurierung je Anteil		0.39	0.21	0.25	0.46
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.43 %
Klasse N					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		332'645'987.75	283'051'458.89	294'933'111.88	230'664'277.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'457'334.082	3'082'154.500	2'957'388.345	2'259'428.980
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.21	91.84	99.73	102.09
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.55	91.54	99.81	101.92
Thesaurierung je Anteil		0.78	0.59	0.66	0.87
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse A	4.98 %	6.44 %	-11.12 %	-1.64 %
Klasse B	5.13 %	6.60 %	-11.00 %	-1.50 %
Klasse I	4.59 %	7.45 %	-11.13 %	-1.35 %
Klasse N	5.00 %	7.89 %	-10.78 %	-0.94 %
Klasse V (Lancierung 13.04.2021, Schliessung 30.11.2021)	-	-	-	-0.32 %

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)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	7'050'624.16	2'337'105.10
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	661'342'186.50	611'053'457.00
Sonstige Vermögenswerte	3'720'187.33	2'585'915.95
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	672'112'997.99	615'976'478.05
Andere Verbindlichkeiten	-141'715.46	-126'430.21
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	671'971'282.53	615'850'047.84

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse A	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		103'906.658	101'805.531
Ausgegebene Anteile		34'890.628	26'978.896
Zurückgenommene Anteile		-21'235.489	-24'877.769
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		117'561.797	103'906.658
Klasse B	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		150'326.787	125'408.571
Ausgegebene Anteile		32'002.305	42'096.371
Zurückgenommene Anteile		-21'297.512	-17'178.155
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		161'031.580	150'326.787
Klasse I	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'469'505.219	3'408'774.904
Ausgegebene Anteile		490'966.473	453'073.621
Zurückgenommene Anteile		-604'214.690	-392'343.306
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'356'257.002	3'469'505.219
Klasse N	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'082'154.500	2'957'388.345
Ausgegebene Anteile		497'198.104	267'215.951
Zurückgenommene Anteile		-122'018.522	-142'449.796
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'457'334.082	3'082'154.500

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		615'850'047.84	648'766'920.55
Ausbezahlte Ausschüttung		-31'189.40	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-933'196.12	-1'022'093.14
Saldo aus dem Anteilverkehr		26'676'552.91	19'974'132.98
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		30'409'067.30	-51'868'912.55
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		671'971'282.53	615'850'047.84

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		14'925.65	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-31'081.35
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		5'362'327.41	3'989'483.34
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		361'970.56	124'547.45
Total Ertrag		5'739'223.62	4'082'949.44
Aufwand			
Passivzinsen		-2.90	-267.25
Prüfaufwand		-13'485.37	-6'143.17
Reglementarische Vergütungen		-1'402'366.71	-1'386'030.64
Sonstige Aufwendungen		-1'423.73	-522.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-231'865.79	-85'875.29
Total Aufwand		-1'649'144.50	-1'478'839.25
Nettoertrag / Verlust		4'090'079.12	2'604'110.19
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'957'347.00	-10'123'634.73
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		283'658.65	183'145.81
Realisierter Erfolg		2'416'390.77	-7'336'378.73
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		27'992'676.53	-44'532'533.82
Gesamterfolg		30'409'067.30	-51'868'912.55

Verwendung des Erfolges

Klasse A	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	15'672.11	-5'118.16
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	0.00	5'118.16
Vortrag des Vorjahres	9'791.41	9'791.41
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	25'463.52	9'791.41
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	23'512.36	0.00
Vortrag auf neue Rechnung	1'951.16	9'791.41
Total	25'463.52	9'791.41
Klasse B	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	41'191.87	15'732.54
Vortrag des Vorjahres	3'486.79	17'819.61
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	44'678.66	33'552.15
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	40'257.90	30'065.36
Vortrag auf neue Rechnung	4'420.76	3'486.79
Total	44'678.66	33'552.15
Klasse I	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'334'577.53	759'793.60
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'334'577.53	759'793.60
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	467'102.14	265'927.76
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	867'475.39	493'865.84
Total	1'334'577.53	759'793.60
Klasse N	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	2'698'637.61	1'833'702.21
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'698'637.61	1'833'702.21
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	944'523.16	641'795.77
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'754'114.45	1'191'906.44
Total	2'698'637.61	1'833'702.21

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							661'342'186.50	98.40	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							661'342'186.50	98.40	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	2'700	0	0	2'700 CHF	113.08%	3'053'160.00	0.45	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	3'000	0	0	3'000 CHF	118.79%	3'563'700.00	0.53	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	800	0	0	800 CHF	100.85%	806'800.00	0.12	a)
CH0130501304	2.7500 % KWLILI 2 3/4 06/09/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204477308	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/13/23	510	0	510	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	1'000	0	0	1'000 CHF	99.92%	999'200.00	0.15	a)
CH0212184078	1.8750 % SLHNVX 1 7/8 06/21/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	1'200	0	0	1'200 CHF	100.41%	1'204'920.00	0.18	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	3'000	0	0	3'000 CHF	98.19%	2'945'700.00	0.44	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	2'000	0	0	2'000 CHF	95.82%	1'916'400.00	0.29	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	600	0	0	600 CHF	99.89%	599'340.00	0.09	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	860	0	0	860 CHF	100.35%	863'010.00	0.13	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	20	0	20	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253592767	1.6250 % IMPNSW 1 5/8 10/15/24	160	0	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	3'000	0	1'000	2'000 CHF	99.39%	1'987'800.00	0.30	a)
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	550	0	0	550 CHF	100.08%	550'440.00	0.08	a)
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	1'100	0	0	1'100 CHF	99.64%	1'096'040.00	0.16	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	1'500	0	0	1'500 CHF	98.77%	1'481'550.00	0.22	a)
CH0276237663	0.3000 % GEBNVX 0.3 04/17/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	1'500	0	0	1'500 CHF	98.64%	1'479'600.00	0.22	a)
CH0292984470	1.2500 % NANTDR 1 1/4 10/23/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	1'500	0	0	1'500 CHF	98.32%	1'474'800.00	0.22	a)
CH0297782952	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/21/23	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790115	0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN	640	0	640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	2'100	0	0	2'100 CHF	97.38%	2'044'980.00	0.30	a)
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	400	0	0	400 CHF	99.05%	396'200.00	0.06	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	2'900	0	1'400	1'500 CHF	99.54%	1'493'100.00	0.22	a)
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	630	0	630	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593860	0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN	600	0	0	600 CHF	98.75%	592'500.00	0.09	a)
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	500	0	0	500 CHF	96.20%	481'000.00	0.07	a)
CH0316994661	1.0000 % IMPNSW 1 03/20/26	2'500	0	0	2'500 CHF	97.85%	2'446'250.00	0.36	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	1'600	0	0	1'600 CHF	96.60%	1'545'600.00	0.23	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	500	0	0	500 CHF	97.25%	486'250.00	0.07	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'090	0	0	1'090 CHF	98.35%	1'072'015.00	0.16	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	500	0	0	500 CHF	97.50%	487'500.00	0.07	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	800	0	0	800 CHF	98.29%	786'320.00	0.12	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	1'700	0	0	1'700 CHF	95.56%	1'624'520.00	0.24	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.79%	987'900.00	0.15	a)
CH0326213904	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 07/04/23	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	500	0	0	500 CHF	94.75%	473'750.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143170	0.0000 % PSPNSW 0 09/01/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352809	1.5000 % KUDSW 1 1/2 09/27/24	100	0	0	100 CHF	72.00%	72'000.00	0.01	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	2'500	0	0	2'500 CHF	96.19%	2'404'750.00	0.36	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	1'500	0	0	1'500 CHF	96.58%	1'448'700.00	0.22	a)
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	600	0	0	600 CHF	91.85%	551'100.00	0.08	a)
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	490	0	0	490 CHF	97.00%	475'300.00	0.07	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	900	0	0	900 CHF	96.20%	865'800.00	0.13	a)
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	320	0	0	320 CHF	92.30%	295'360.00	0.04	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	4'000	0	0	4'000 CHF	90.57%	3'622'800.00	0.54	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	2'000	0	0	2'000 CHF	97.43%	1'948'600.00	0.29	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	800	0	0	800 CHF	94.60%	756'800.00	0.11	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.50%	780'000.00	0.12	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	700	0	0	700 CHF	99.25%	694'750.00	0.10	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	600	0	0	600 CHF	97.80%	586'800.00	0.09	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.25%	962'500.00	0.14	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	765	0	0	765 CHF	97.75%	747'787.50	0.11	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	700	0	0	700 CHF	97.80%	684'600.00	0.10	a)
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	2'000	0	300	1'700 CHF	97.41%	1'655'970.00	0.25	a)
CH0359915433	1.0050 % MBKPW 1.005 03/28/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	95.00%	760'000.00	0.11	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.05%	784'400.00	0.12	a)
CH0360172735	1.7500 % TEMNSW 1 3/4 04/05/24	600	0	0	600 CHF	99.84%	599'040.00	0.09	a)
CH0360172743	1.3750 % UBXNSW 1 3/8 04/18/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	1'200	0	0	1'200 CHF	96.95%	1'163'400.00	0.17	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	800	0	0	800 CHF	98.05%	784'400.00	0.12	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.34%	993'400.00	0.15	a)
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	600	0	0	600 CHF	99.50%	597'000.00	0.09	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	800	0	0	800 CHF	96.55%	772'400.00	0.11	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'000	0	0	1'000 CHF	95.40%	954'000.00	0.14	a)
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	1'750	0	0	1'750 CHF	91.12%	1'594'600.00	0.24	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	600	0	0	600 CHF	98.91%	593'460.00	0.09	a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.95%	979'500.00	0.15	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	600	0	0	600 CHF	97.70%	586'200.00	0.09	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	700	0	0	700 CHF	97.85%	684'950.00	0.10	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476032	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 12/08/25 0	1'440	0	0	1'440 CHF	98.00%	1'411'200.00	0.21	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	750	0	0	750 CHF	98.05%	735'375.00	0.11	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	1'500	0	0	1'500 CHF	95.94%	1'439'100.00	0.21	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	450	0	0	450 CHF	97.75%	439'875.00	0.07	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 11/24/33	2'000	0	0	2'000 CHF	93.05%	1'861'000.00	0.28	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	1'500	0	0	1'500 CHF	96.06%	1'440'900.00	0.21	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	800	0	0	800 CHF	98.60%	788'800.00	0.12	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	0	0	1'000 CHF	95.80%	958'000.00	0.14	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	1'200	0	0	1'200 CHF	96.63%	1'159'560.00	0.17	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	1'000	0	0	1'000 CHF	97.65%	976'500.00	0.15	a)
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	600	0	0	600 CHF	97.75%	586'500.00	0.09	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	800	0	0	800 CHF	98.42%	787'360.00	0.12	a)
CH0373476735	1.8750 % MCHNSW 1 7/8 05/16/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	96.35%	1'059'850.00	0.16	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	800	0	0	800 CHF	94.25%	754'000.00	0.11	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	800	0	0	800 CHF	95.40%	763'200.00	0.11	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610964	0.6250 % ORONSW 0 5/8 09/26/23	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610998	1.7500 % BALHOL 1 3/4 PERP	230	0	230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	98.10%	2'550'600.00	0.38	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	96.40%	771'200.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	700	0	0	700 CHF	98.70%	690'900.00	0.10	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	690	0	690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	500	0	0	500 CHF	98.45%	492'250.00	0.07	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.20%	777'600.00	0.12	a)
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	600	0	0	600 CHF	98.90%	593'400.00	0.09	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	800	0	0	800 CHF	95.50%	764'000.00	0.11	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	1'000	0	0	1'000 CHF	97.63%	976'300.00	0.15	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397642775	0.3250 % SPSNSW 0.325 01/16/25 SPSN	6'000	0	0	6'000 CHF	97.70%	5'862'150.00	0.87	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	550	0	0	550 CHF	96.05%	528'275.00	0.08	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	800	0	0	800 CHF	97.05%	776'400.00	0.12	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	500	0	0	500 CHF	96.70%	483'500.00	0.07	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	700	0	0	700 CHF	95.70%	669'900.00	0.10	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	800	0	0	800 CHF	98.05%	784'400.00	0.12	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	2'000	0	1'000	1'000 CHF	98.87%	988'700.00	0.15	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	1'500	0	0	1'500 CHF	96.30%	1'444'500.00	0.21	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	600	0	0	600 CHF	97.15%	582'900.00	0.09	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	96.80%	2'420'000.00	0.36	a)
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	800	0	0	800 CHF	95.65%	765'200.00	0.11	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.80%	1'452'000.00	0.22	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401673980	0.6250 % EBIUH 0 5/8 02/09/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	95.00%	760'000.00	0.11	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.42%	984'200.00	0.15	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.30%	973'000.00	0.14	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.65%	781'200.00	0.12	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.50%	985'000.00	0.15	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	99.03%	1'089'330.00	0.16	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	600	0	0	600 CHF	98.65%	591'900.00	0.09	a)
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.45%	964'500.00	0.14	a)
CH0413618353	0.7000 % KSBAAAR 0.7 05/23/28	500	0	0	500 CHF	97.15%	485'750.00	0.07	a)
CH0414510054	0.2500 % SCHPSW 0 1/4 06/05/23 MTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0416239777	0.5500 % RENAUL 0.55 05/30/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086052	1.5000 % VACNSW 1 1/2 05/23/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	98.96%	494'800.00	0.07	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	3'000	0	0	3'000 CHF	94.42%	2'832'600.00	0.42	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	1'000	0	0	1'000 CHF	93.85%	938'500.00	0.14	a)
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	700	0	0	700 CHF	96.55%	675'850.00	0.10	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	600	0	0	600 CHF	91.25%	547'500.00	0.08	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	250	0	0	250 CHF	94.95%	237'375.00	0.04	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	1'500	0	0	1'500 CHF	84.95%	1'274'250.00	0.19	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'000	0	0	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.13	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.05%	920'500.00	0.14	a)
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	800	0	0	800 CHF	90.45%	723'600.00	0.11	a)
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.80%	2'371'200.00	0.35	a)
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	300	0	0	300 CHF	92.20%	276'600.00	0.04	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	94.80%	758'400.00	0.11	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.50%	935'000.00	0.14	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	2'500	0	0	2'500 CHF	96.06%	2'401'500.00	0.36	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0426621709	0.1500 % CM 0.15 07/31/23 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	1'000	0	0	1'000 CHF	96.01%	960'100.00	0.14	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	900	0	0	900 CHF	98.25%	884'250.00	0.13	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	99.09%	792'720.00	0.12	a)
CH0429659615	0.4075 % KEBHNB 0.4075 09/14/23	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0429659623	0.1500 % KORWAT 0.15 09/20/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678360	2.0000 % CPHNSW 2 10/12/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	1'500	0	0	1'500 CHF	96.87%	1'453'050.00	0.22	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNXX 0 3/4 10/12/28	800	0	0	800 CHF	97.35%	778'800.00	0.12	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	3'000	0	0	3'000 CHF	91.70%	2'751'000.00	0.41	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	10'000	0	0	10'000 CHF	87.01%	8'701'000.00	1.29	a)
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	600	0	0	600 CHF	99.93%	599'580.00	0.09	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.15	a)
CH0441186472	1.6300 % CPIPGR 1.63 10/25/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.70%	781'600.00	0.12	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	800	0	0	800 CHF	96.55%	772'400.00	0.11	a)
CH0446595628	1.8750 % TEMNSW 1 7/8 11/30/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595651	0.9500 % SPIMAE 0.95 12/12/23	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.78%	790'240.00	0.12	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	800	0	0	800 CHF	95.80%	766'400.00	0.11	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.55%	965'500.00	0.14	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	5'000	0	0	5'000 CHF	89.42%	4'471'000.00	0.67	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.47%	984'700.00	0.15	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	750	0	0	750 CHF	96.30%	722'250.00	0.11	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	1'500	0	0	1'500 CHF	90.20%	1'353'000.00	0.20	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	3'000	0	0	3'000 CHF	84.70%	2'541'000.00	0.38	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	2'000	0	0	2'000 CHF	90.35%	1'807'000.00	0.27	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	1'200	0	0	1'200 CHF	92.20%	1'106'400.00	0.16	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.00%	930'000.00	0.14	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	500	0	0	500 CHF	93.80%	469'000.00	0.07	a)
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	0	650	0	650 CHF	89.05%	578'825.00	0.09	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	830	0	0	830 CHF	99.72%	827'676.00	0.12	a)
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	800	0	0	800 CHF	99.90%	799'200.00	0.12	a)
CH0463112083	0.2500 % SLHNXX 0 1/4 10/11/23	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.80%	978'000.00	0.15	a)
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.55%	788'400.00	0.12	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.77%	987'700.00	0.15	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.70%	927'000.00	0.14	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	2'500	0	0	2'500 CHF	93.89%	2'347'250.00	0.35	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.14	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	3'750	0	0	3'750 CHF	91.77%	3'441'375.00	0.51	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	600	0	0	600 CHF	92.60%	555'600.00	0.08	a)
CH0482172415	0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.61%	1'479'150.00	0.22	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.01%	784'080.00	0.12	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.60%	976'000.00	0.15	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	2'000	0	0	2'000 CHF	95.72%	1'914'400.00	0.28	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	2'000	1'450	0	3'450 CHF	88.55%	3'054'975.00	0.45	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	8'000	0	0	8'000 CHF	68.82%	5'505'600.00	0.82	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	1'250	0	0	1'250 CHF	97.75%	1'221'875.00	0.18	a)
CH0486598227	0.0000 % CMBNSW 0 07/09/26	5'000	0	0	5'000 CHF	94.15%	4'707'500.00	0.70	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	625	0	0	625 CHF	89.10%	556'875.00	0.08	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	1'000	0	0	1'000 CHF	88.90%	889'000.00	0.13	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	600	0	0	600 CHF	88.20%	529'200.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0498400586	0.1000 % CAABNK 0.1 10/23/23	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.20%	912'000.00	0.14	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.75%	967'500.00	0.14	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	94.50%	1'417'500.00	0.21	a)
CH0505011962	0.4500 % BSTDBK 0.45 06/13/23	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	1'500	0	0	1'500 CHF	93.75%	1'406'250.00	0.21	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	4'000	0	0	4'000 CHF	90.48%	3'619'200.00	0.54	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.15%	931'500.00	0.14	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	2'000	0	0	2'000 CHF	88.25%	1'765'000.00	0.26	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.00%	940'000.00	0.14	a)
CH0508785745	1.5000 % TEMNSW 1 1/2 11/28/25	600	0	0	600 CHF	99.50%	597'000.00	0.09	a)
CH0511762038	0.5225 % AFRFIN 0.5225 12/20/23 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	2'000	0	0	2'000 CHF	95.96%	1'919'200.00	0.29	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	92.65%	1'389'750.00	0.21	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	97.47%	1'462'050.00	0.22	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	89.70%	1'794'000.00	0.27	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	94.55%	2'836'500.00	0.42	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.40%	1'848'000.00	0.27	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.35%	1'787'000.00	0.27	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	3'700	0	0	3'700 CHF	85.70%	3'170'900.00	0.47	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	2'000	0	0	2'000 CHF	91.65%	1'833'000.00	0.27	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	4'000	0	0	4'000 CHF	95.85%	3'834'000.00	0.57	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	87.70%	1'315'500.00	0.20	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	3'000	0	0	3'000 CHF	94.84%	2'845'200.00	0.42	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	1'500	0	0	1'500 CHF	92.10%	1'381'500.00	0.21	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	750	0	0	750 CHF	98.25%	736'875.00	0.11	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	3'000	0	0	3'000 CHF	92.29%	2'768'700.00	0.41	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	330	0	0	330 CHF	86.55%	285'615.00	0.04	a)
CH0536893172	1.5000 % BCHNSW 1 1/2 09/30/24	1'500	0	0	1'500 CHF	99.55%	1'493'250.00	0.22	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	800	0	0	800 CHF	94.80%	758'400.00	0.11	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	3'500	0	0	3'500 CHF	94.70%	3'314'500.00	0.49	a)
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	1'020	0	0	1'020 CHF	85.25%	869'550.00	0.13	a)
CH0539032943	1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	98.60%	1'479'000.00	0.22	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	1'275	0	0	1'275 CHF	96.35%	1'228'462.50	0.18	a)
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	500	0	0	500 CHF	93.10%	465'500.00	0.07	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	950	0	0	950 CHF	98.30%	933'850.00	0.14	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	5'000	0	0	5'000 CHF	81.45%	4'072'500.00	0.61	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	2'700	0	0	2'700 CHF	96.85%	2'614'950.00	0.39	a)
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	2'000	0	0	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.27	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	450	0	0	450 CHF	95.65%	430'425.00	0.06	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	320	0	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	4'000	0	0	4'000 CHF	92.59%	3'703'600.00	0.55	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.70%	1'934'000.00	0.29	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	1'600	0	0	1'600 CHF	93.35%	1'493'600.00	0.22	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'500	0	0	1'500 CHF	97.96%	1'469'400.00	0.22	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	10'000	0	0	10'000 CHF	93.59%	9'359'000.00	1.39	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	4'000	0	0	4'000 CHF	87.43%	3'497'200.00	0.52	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	10'000	0	0	10'000 CHF	83.50%	8'350'000.00	1.24	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	4'000	0	0	4'000 CHF	90.44%	3'617'600.00	0.54	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	2'000	0	0	2'000 CHF	90.45%	1'809'000.00	0.27	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	95.30%	1'429'500.00	0.21	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	0	600	0	600 CHF	85.30%	511'800.00	0.08	a)
CH0593641050	1.2500 % MEDCLI 1 1/4 02/25/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	1'290	0	0	1'290 CHF	89.40%	1'153'260.00	0.17	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	91.25%	1'368'750.00	0.20	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.40%	944'000.00	0.14	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	1'500	0	0	1'500 CHF	94.00%	1'410'000.00	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	3'400	0	0	3'400 CHF	92.05%	3'129'700.00	0.47	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	89.25%	1'785'000.00	0.27	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	6'535	0	0	6'535 CHF	94.78%	6'193'873.00	0.92	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	3'000	0	0	3'000 CHF	92.90%	2'787'000.00	0.41	a)
CH1101096563	1.3000 % COTNSW 1.3 04/20/26	1'010	0	0	1'010 CHF	98.50%	994'850.00	0.15	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	1'750	0	0	1'750 CHF	95.05%	1'663'375.00	0.25	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	2'000	0	0	2'000 CHF	90.30%	1'806'000.00	0.27	a)
CH1101561491	2.1250 % SLHNWX 2 1/8 09/30/41	3'500	0	0	3'500 CHF	93.40%	3'269'000.00	0.49	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101825797	2.2500 % RAIFFS 2 1/4 PERP	1'500	0	0	1'500 CHF	95.50%	1'432'500.00	0.21	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	2'500	0	0	2'500 CHF	91.95%	2'298'750.00	0.34	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	950	0	0	950 CHF	93.70%	890'150.00	0.13	a)
CH1105672724	0.1250 % PSYPO 0 1/8 06/20/31 701	7'000	0	0	7'000 CHF	91.04%	6'372'800.00	0.95	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	3'000	0	0	3'000 CHF	96.05%	2'881'500.00	0.43	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.10%	1'882'000.00	0.28	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	93.90%	2'817'000.00	0.42	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	95.30%	3'812'000.00	0.57	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	1'250	0	0	1'250 CHF	90.65%	1'133'125.00	0.17	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	3'000	0	0	3'000 CHF	96.15%	2'884'500.00	0.43	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	2'000	0	0	2'000 CHF	93.15%	1'863'000.00	0.28	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	1'625	0	0	1'625 CHF	96.50%	1'568'125.00	0.23	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	95.00%	2'850'000.00	0.42	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	92.10%	2'763'000.00	0.41	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	2'000	0	0	2'000 CHF	91.55%	1'831'000.00	0.27	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	1'400	0	0	1'400 CHF	93.75%	1'312'500.00	0.20	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	4'000	0	0	4'000 CHF	81.95%	3'278'000.00	0.49	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'195	0	0	1'195 CHF	88.90%	1'062'355.00	0.16	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	93.85%	3'754'000.00	0.56	a)
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	89.50%	2'327'000.00	0.35	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	93.50%	1'729'750.00	0.26	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.80%	1'896'000.00	0.28	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.50%	1'890'000.00	0.28	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'135	0	0	1'135 CHF	90.25%	1'024'337.50	0.15	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.30%	923'000.00	0.14	a)
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	87.85%	2'635'500.00	0.39	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	93.05%	3'722'000.00	0.55	a)
CH1142231716	1.4000 % RIENSW 1.4 11/25/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.20%	1'443'000.00	0.21	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.85%	1'897'000.00	0.28	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	2'000	0	0	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.27	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	1'040	0	0	1'040 CHF	91.35%	950'040.00	0.14	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	93.20%	1'864'000.00	0.28	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	4'000	0	0	4'000 CHF	91.04%	3'641'600.00	0.54	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	4'000	0	0	4'000 CHF	92.40%	3'696'000.00	0.55	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'370	0	0	2'370 CHF	90.25%	2'138'925.00	0.32	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	3'000	0	0	3'000 CHF	91.12%	2'733'600.00	0.41	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	6'000	0	0	6'000 CHF	83.79%	5'027'400.00	0.75	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	5'000	0	0	5'000 CHF	90.87%	4'543'500.00	0.68	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	2'000	0	0	2'000 CHF	89.85%	1'797'000.00	0.27	a)
CH1151526196	0.3750 % PSYPO 0 3/8 02/16/37 712	10'000	0	0	10'000 CHF	86.52%	8'652'000.00	1.29	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	6'000	0	0	6'000 CHF	90.31%	5'418'360.00	0.81	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	92.05%	2'761'500.00	0.41	a)
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	3'000	0	0	3'000 CHF	94.00%	2'820'000.00	0.42	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	92.80%	2'784'000.00	0.41	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	4'000	0	0	4'000 CHF	96.05%	3'842'000.00	0.57	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	4'000	0	0	4'000 CHF	94.05%	3'762'000.00	0.56	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	4'000	0	0	4'000 CHF	97.95%	3'918'000.00	0.58	a)
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	1'405	0	0	1'405 CHF	97.95%	1'376'197.50	0.20	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	5'000	0	0	5'000 CHF	95.05%	4'752'500.00	0.71	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	4'000	0	0	4'000 CHF	98.40%	3'936'000.00	0.59	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	3'750	0	0	3'750 CHF	97.85%	3'669'375.00	0.55	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	99.15%	2'478'750.00	0.37	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	1'500	0	0	1'500 CHF	99.05%	1'485'750.00	0.22	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	825	0	0	825 CHF	99.50%	820'875.00	0.12	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	2'675	0	0	2'675 CHF	101.55%	2'716'462.50	0.40	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	1'250	0	0	1'250 CHF	100.25%	1'253'125.00	0.19	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	3'000	0	0	3'000 CHF	100.05%	3'001'500.00	0.45	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	3'000	0	0	3'000 CHF	100.75%	3'022'500.00	0.45	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	1'500	0	0	1'500 CHF	101.45%	1'521'750.00	0.23	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.94%	2'998'200.00	0.45	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	3'000	0	0	3'000 CHF	105.45%	3'163'500.00	0.47	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	7'000	0	0	7'000 CHF	110.47%	7'732'900.00	1.15	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	8'000	0	0	8'000 CHF	104.80%	8'384'000.00	1.25	a)
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.80%	2'994'000.00	0.45	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	3'600	0	0	3'600 CHF	99.73%	3'590'280.00	0.53	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	1'350	0	0	1'350 CHF	101.60%	1'371'600.00	0.20	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	2'000	0	0	2'000 CHF	105.35%	2'107'000.00	0.31	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	0	1'710	0	1'710 CHF	110.50%	1'889'550.00	0.28	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	2'500	0	0	2'500 CHF	101.90%	2'547'500.00	0.38	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	3'000	0	0	3'000 CHF	105.00%	3'150'000.00	0.47	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	2'500	0	0	2'500 CHF	103.05%	2'576'250.00	0.38	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	106.60%	2'665'000.00	0.40	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.95%	2'079'000.00	0.31	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	0	3'000	0	3'000 CHF	105.36%	3'160'800.00	0.47	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	11'150	0	0	11'150 CHF	109.20%	12'175'800.00	1.81	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.40%	2'048'000.00	0.30	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	3'000	0	0	3'000 CHF	103.35%	3'100'500.00	0.46	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	6'000	0	0	6'000 CHF	102.95%	6'177'000.00	0.92	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	4'000	0	0	4'000 CHF	102.40%	4'096'000.00	0.61	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	2'500	0	0	2'500 CHF	103.00%	2'575'000.00	0.38	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	5'000	0	5'000 CHF	110.50%	5'525'000.00	0.82	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	900	0	0	900 CHF	106.35%	957'150.00	0.14	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	102.30%	3'069'000.00	0.46	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	2'500	0	0	2'500 CHF	104.55%	2'613'750.00	0.39	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	3'000	0	3'000 CHF	103.00%	3'090'000.00	0.46	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	8'000	0	8'000 CHF	106.45%	8'516'000.00	1.27	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	105.45%	3'163'500.00	0.47	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	3'000	0	3'000 CHF	105.30%	3'159'000.00	0.47	a)
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	104.00%	3'120'000.00	0.46	a)
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	1'710	1'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	1'000	0	1'000 CHF	103.40%	1'034'000.00	0.15	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	0	3'000	0	3'000 CHF	104.75%	3'142'500.00	0.47	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	3'710	0	3'710 CHF	107.15%	3'975'265.00	0.59	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	4'000	0	4'000 CHF	109.10%	4'364'000.00	0.65	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	104.50%	3'657'500.00	0.54	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	3'000	0	3'000 CHF	102.00%	3'060'000.00	0.46	a)
CH1280154282	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 AUG	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	3'500	0	3'500 CHF	103.25%	3'613'750.00	0.54	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	0	2'500	0	2'500 CHF	108.55%	2'713'750.00	0.40	a)
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	0	2'500	0	2'500 CHF	113.95%	2'848'750.00	0.42	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	1'600	0	1'600 CHF	102.00%	1'632'000.00	0.24	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	0	3'000	0	3'000 CHF	101.25%	3'037'500.00	0.45	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	1'100	0	1'100 CHF	104.65%	1'151'150.00	0.17	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	3'140	0	3'140 CHF	101.30%	3'180'820.00	0.47	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.25%	2'025'000.00	0.30	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	2'500	0	2'500 CHF	102.50%	2'562'500.00	0.38	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	3'000	0	3'000 CHF	108.60%	3'258'000.00	0.48	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	1'650	0	1'650 CHF	104.25%	1'720'125.00	0.26	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	101.25%	2'531'250.00	0.38	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	2'000	0	2'000 CHF	99.87%	1'997'400.00	0.30	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	2'000	0	2'000 CHF	99.72%	1'994'400.00	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1307121272	2.3750 % KWLIL 2 3/8 12/05/29	0	625	0	625 CHF	103.50%	646'875.00	0.10	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	1'200	0	1'200 CHF	101.40%	1'216'800.00	0.18	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.10%	3'003'000.00	0.45	a)
CHF							661'342'186.50	98.40	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	7'050'624.16	1.05
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	661'342'186.50	98.40
Sonstige Vermögenswerte	3'720'187.33	0.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	672'112'997.99	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-141'715.46	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	671'971'282.53	

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);	661'342'186.50	98.40
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

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: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
A	CHF	-	-	-	-
B	CHF	-	-	-	-
I	CHF	-	-	-	-
N	CHF	-	-	-	-

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, das Asset Management und den Vertrieb des Anlagefonds wie auch für die Entschädigung der Depotbank für die von ihr erbrachten Dienstleistungen.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		VK Zielfonds
	Eff	Max	p.a. in %
A	0.700	1.100	4.000
B	0.550	0.800	4.000
I	0.400	0.600	4.000
N	-	-	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.

8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

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 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
A	Nein	CHF	0.20000	0.07000	0.13000
B	Nein	CHF	0.25000	0.08750	0.16250

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
I	Nein	CHF	0.39763	0.13917	0.25846
N	Nein	CHF	0.78055	0.27319	0.50736

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss der vorstehenden Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem

Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8 des Prospekts) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen 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 Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

GKB (CH)

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»
(nachfolgend «Umbrella-Fonds»)

mit den Teilvermögen

GKB (CH) Obligationen CHF ESG

GKB (CH) Aktien Schweiz ESG

GKB (CH) Aktien Welt ESG

GKB (CH) Vorsorgefonds 25 ESG

GKB (CH) Vorsorgefonds 45 ESG

GKB (CH) Strategiefonds Einkommen ESG

GKB (CH) Strategiefonds Ausgewogen ESG

GKB (CH) Strategiefonds Wachstum ESG

GKB (CH) Strategiefonds Kapitalgewinn ESG

(nachfolgend «Teilvermögen»)

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

Unter § 8 wird die Nummerierung der Ziffern geändert und bei der Definition von Forderungswertpapieren eine Ergänzung vorgenommen.

Die Nummerierung unter § 8 wird wie folgt geändert: § 8 Ziff. 1 wird um den Titel "Zulässige Anlagen" und Ziff. 2 um "Nachhaltigkeitspolitik" ergänzt. Bis anhin war unter § 8 Ziff. 3 bis Ziff. 11 die teilfondsspezifische Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen dargelegt. Neu wird Ziff. 3 mit dem Titel "Teilfondsspezifische Anlagepolitik" versehen und die teilfondsspezifische Anlagepolitik der neun Teilvermögen mit den Ziffern 3.1 bis 3.9 nummeriert. Schliesslich wird § 8 Ziff. 12 in § 8 Ziff. 4 umbenannt und mit dem Titel "Liquiditätsmanagement" versehen.

Die teilfondsspezifische Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen wird betreffend Forderungswertpapieren und -wertrechten bei der beispielhaften Aufzählung zulässiger Anlageinstrumente um Bail-in Bonds ergänzt: vgl. Anpassung je Teilvermögen unter folgenden Bestimmungen des geänderten Fondsvertrages:

GKB (CH) Obligationen CHF ESG: § 8 Ziff. 3.1 (bisher § 8 Ziff. 3) lit. aa

GKB (CH) Vorsorgefonds 25 ESG: § 8 Ziff. 3.4 (bisher § 8 Ziff. 6) lit. ba

GKB (CH) Vorsorgefonds 45 ESG: § 8 Ziff. 3.5 (bisher § 8 Ziff. 7) lit. ba

GKB (CH) Strategiefonds Einkommen ESG: § 8 Ziff. 3.6 (bisher § 8 Ziff. 8) lit. ba

GKB (CH) Strategiefonds Ausgewogen ESG: § 8 Ziff. 3.7 (bisher § 8 Ziff. 9) lit. ba

GKB (CH) Strategiefonds Wachstum ESG: § 8 Ziff. 3.8 (bisher § 8 Ziff. 10) lit. bb

GKB (CH) Strategiefonds Kapitalgewinn ESG: § 8 Ziff. 3.9 (bisher § 8 Ziff. 11) lit. bb.

Bei den Teilvermögen GKB (CH) Aktien Schweiz ESG und GKB (CH) Aktien Welt ESG wird der Wortlaut, was unter Forderungswertpapieren und -wertrechten zu verstehen ist, angepasst und lautet neu wie folgt, vgl. beim Teilvermögen GKB (CH) Aktien Schweiz ESG § 8 Ziff. 3.2 (bisher § 8 Ziff. 4) lit. bb und beim Teilvermögen GKB (CH) Aktien Welt ESG § 8 Ziff. 3.3 (bisher § 8 Ziff. 5) lit. ba:

"Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds und Ähnliches) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldnern;"

Neben den umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

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

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

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

Zürich, 26. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich