

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE

Halbjahresbericht per 31.07.2023

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	277967	CHF
BA CHF	42725059	CHF
CT CHF	44168701	CHF
DA CHF	2561683	CHF
GT CHF	20594562	CHF
NT CHF	21580119	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	21
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
7	Pauschale Verwaltungskommission	22
8	Benchmark	22
9	TER	22
10	Fussnoten	23
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24

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	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.07.2023	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		688'445'166.74	795'295'053.50	933'394'838.88	902'583'938.30
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		90'787'560.59	105'716'398.64	142'942'516.80	182'335'646.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'560'291.137	1'674'928.534	1'955'512.971	2'407'440.233
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		58.1863	63.1170	73.0972	75.7400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		58.1397	63.0475	73.0606	75.8400
Ausschüttung je Anteil		-	0.45	0.40	0.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.97 %	0.96 %	0.96 %	0.96 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'009'729.55	1'019'261.94	589'661.01	810'037.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'054.540	12'132.889	6'052.683	8'022.298
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.3470	84.0082	97.4214	100.9700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		77.2851	83.9158	97.3727	101.1000
Ausschüttung je Anteil		-	0.85	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.60 %	0.59 %	0.59 %	0.59 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'759'433.36	3'063'553.70	3'675'136.14	4'156'655.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		33'505.189	34'490.386	35'954.366	39'566.894
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.3584	88.8234	102.2167	105.0500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		82.2925	88.7257	102.1656	105.1900
Thesaurierung je Anteil		-	0.95	1.11	1.34
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.51 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse DA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'847'654.02	16'614'787.89	19'733'724.77	20'938'776.15
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		222'985.473	229'335.473	234'785.473	240'212.203
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		66.5857	72.4475	84.0500	87.1700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		66.5325	72.3678	84.0080	87.2800
Ausschüttung je Anteil		-	0.90	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.47 %	0.46 %	0.46 %	0.46 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'227'074.98	61'808'776.29	69'762'668.81	58'761'597.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		136'912.618	641'812.618	629'920.618	516'627.618
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.3057	96.3035	110.7484	113.7400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.2342	96.1975	110.6930	113.8900
Thesaurierung je Anteil		-	1.15	1.32	1.58
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.39 %	0.39 %	0.39 %

Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		566'813'714.24	607'072'275.04	696'691'131.35	635'581'225.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'196'462.698	6'157'135.698	6'159'104.505	5'484'630.170
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.4738	98.5965	113.1157	115.8800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.4006	98.4881	113.0591	116.0300
Thesaurierung je Anteil		-	1.56	1.79	2.05
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.02 %	0.01 %	0.01 %	0.01 %

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

Performance

	YTD / 31.07.2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	-4.90 %	-15.35 %	-3.05 %	-0.73 %
Klasse BA CHF	-4.69 %	-15.04 %	-2.68 %	-0.37 %
Klasse CT CHF	-4.65 %	-14.96 %	-2.60 %	-0.28 %
Klasse DA CHF	-4.65 %	-14.83 %	-2.55 %	-0.25 %
Klasse GT CHF	-4.61 %	-14.77 %	-2.49 %	-0.17 %
Klasse NT CHF	-4.40 %	-14.45 %	-2.12 %	0.21 %

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)	31.07.2023	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	9'067'802.31	18'605'931.30
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	637'583'322.76	719'683'659.93
Strukturierte Produkte	0.00	11'618'074.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	37'096'269.98	40'577'336.17
Derivative Finanzinstrumente	39'225.72	-54'083.46
Sonstige Vermögenswerte	4'749'510.04	4'981'655.46
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	688'536'130.81	795'412'573.40
Andere Verbindlichkeiten	-90'964.07	-117'519.90
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	688'445'166.74	795'295'053.50

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'674'928.534	1'955'512.971
Ausgegebene Anteile		1'904.313	3'422.235
Zurückgenommene Anteile		-116'541.710	-284'006.672
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'560'291.137	1'674'928.534
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'132.889	6'052.683
Ausgegebene Anteile		921.651	6'200.206
Zurückgenommene Anteile		-	-120.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'054.540	12'132.889
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		34'490.386	35'954.366
Ausgegebene Anteile		166.000	728.439
Zurückgenommene Anteile		-1'151.197	-2'192.419
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		33'505.189	34'490.386
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		229'335.473	234'785.473
Zurückgenommene Anteile		-6'350.000	-5'450.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		222'985.473	229'335.473
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		641'812.618	629'920.618
Ausgegebene Anteile		36'363.000	59'416.000
Zurückgenommene Anteile		-541'263.000	-47'524.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		136'912.618	641'812.618
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		6'157'135.698	6'159'104.505
Ausgegebene Anteile		72'694.000	394'801.511
Zurückgenommene Anteile		-33'367.000	-396'770.318
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		6'196'462.698	6'157'135.698

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		795'295'053.50	933'394'838.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-943'824.95	-979'288.82
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'653'235.16	-4'179'712.45
Saldo aus dem Anteilverkehr		-49'607'066.57	-18'510'372.04
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-52'645'760.08	-114'430'412.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		688'445'166.74	795'295'053.50

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		74'790.51	5'899.36
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-4'018.78	-41'953.78
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		7'065'626.81	11'716'887.99
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		594'078.95	990'961.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		37'050.21	306'247.88
Total Ertrag		7'767'527.70	12'978'042.68
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-95.16
Reglementarische Vergütungen		-612'267.84	-1'470'344.11
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-135.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-373'287.19	-284'605.39
Total Aufwand		-985'639.03	-1'755'179.66
Nettoertrag / Verlust		6'781'888.67	11'222'863.02
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-37'981'405.32	-52'378'490.00
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		59'499.69	99'665.08
Realisierter Erfolg		-31'140'016.96	-41'055'961.90
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-21'505'743.12	-73'374'450.17
Gesamterfolg		-52'645'760.08	-114'430'412.07

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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							674'679'592.74	97.99	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							637'583'322.76	92.60	
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	2'500	0	1'000	1'500 AUD	95.12%	833'467.27	0.12	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	700	1'500	0	2'200 AUD	57.73%	741'863.32	0.11	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	2'000	0	1'300	700 AUD	91.09%	372'469.08	0.05	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	0	1'000	0	1'000 AUD	88.09%	514'528.15	0.07	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	600	0	0	600 AUD	79.49%	278'607.49	0.04	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	1'800	0	0	1'800 AUD	98.48%	1'035'436.14	0.15	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	2'000	0	0	2'000 AUD	94.75%	1'106'920.42	0.16	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	400	0	0	400 AUD	97.20%	227'110.86	0.03	a)
AU3CB0279818	0.8000 % ASIA 0.8 11/06/25 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	92.06%	537'735.51	0.08	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	0	1'500	0	1'500 AUD	99.03%	867'656.21	0.13	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'700	0	0	1'700 AUD	80.10%	795'415.49	0.12	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	2'000	0	0	2'000 AUD	73.86%	862'883.89	0.13	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	74.31%	868'105.99	0.13	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	3'000	0	0	3'000 AUD	85.82%	1'503'840.47	0.22	a)
AUD							10'546'040.29	1.53	
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	2'000	0	0	2'000 CAD	107.94%	1'421'732.79	0.21	a)
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	4'000	0	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	5'200	0	1'100	4'100 CAD	89.80%	2'424'743.28	0.35	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	1'100	0	0	1'100 CAD	92.39%	669'301.52	0.10	a)
CA135087VV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	1'000	0	0	1'000 CAD	200.88%	1'322'918.87	0.19	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	4'000	0	0	4'000 CAD	107.18%	2'823'392.20	0.41	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	2'000	0	0	2'000 CAD	93.79%	1'235'395.44	0.18	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	4'000	0	0	4'000 CAD	97.61%	2'571'447.55	0.37	a)
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	2'000	0	0	2'000 CAD	85.70%	1'128'772.06	0.16	a)
CA74814ZFL28	2.8500 % Q 2.85 12/01/53	0	1'500	0	1'500 CAD	77.20%	762'620.55	0.11	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	85.54%	1'126'690.97	0.16	a)
US052591AT11	5.0000 % AUST 5 12/20/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US000769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	1'500	0	0	1'500 CAD	90.43%	893'354.37	0.13	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	2'500	0	0	2'500 CAD	86.69%	1'427'330.68	0.21	a)
CAD							17'807'700.28	2.59	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501139	0.0000 % SWNBK 0 10/23/23 84	0	1'000	0	1'000 CHF	99.60%	995'950.00	0.14	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	2'500	0	2'500 CHF	102.73%	2'568'250.00	0.37	a)
CHF							3'564'200.00	0.52	
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	4'000	0	0	4'000 CNY	109.16%	529'849.80	0.08	a)
CND10000H9K9	3.5200 % CGB 3.52 05/04/27 1710	50'000	0	25'000	25'000 CNY	104.84%	3'180'553.37	0.46	a)
CND10000HWX0	3.5900 % CGB 3.59 08/03/27 1718	30'000	0	0	30'000 CNY	105.39%	3'836'766.43	0.56	a)
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	30'000	0	0	30'000 CNY	106.44%	3'874'751.59	0.56	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	40'000	0	0	40'000 CNY	104.02%	5'048'845.66	0.73	a)
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	10'000	0	0	10'000 CNY	100.61%	1'220'850.21	0.18	a)
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	50'000	0	0	50'000 CNY	104.39%	6'333'579.12	0.92	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	20'000	0	0	20'000 CNY	105.63%	2'563'488.22	0.37	a)
CND10002LTC8	2.2400 % CGB 2.24 03/05/23 INBK	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	65'000	0	10'000	55'000 CNY	106.22%	7'089'386.70	1.03	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004NXW0	2.8900 % CGB 2.89 11/18/31 INBK	32'500	0	7'500	25'000 CNY	101.52%	3'079'677.42	0.45	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	0	55'000	30'000	25'000 CNY	101.63%	3'083'066.04	0.45	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	0	25'000	0	25'000 CNY	100.95%	3'062'534.09	0.44	a)
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	29'000	0	0	29'000 CNY	98.80%	3'476'840.83	0.50	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	0	0	25'000 CNY	100.23%	3'040'658.22	0.44	a)
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	100.21%	2'431'992.64	0.35	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	100.52%	3'659'383.47	0.53	a)
X52366200850	2.5500 % IBRD 2.55 07/19/23	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CNY							55'512'223.81	8.06	
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	4'500	0	0	4'500 DKK	104.62%	603'778.67	0.09	a)
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	3'000	0	0	3'000 DKK	121.47%	467'335.69	0.07	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'000	0	0	8'000 DKK	97.06%	995'800.89	0.14	a)
DKK							2'066'915.25	0.30	
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	1'500	0	0	1'500 EUR	83.98%	1'203'950.36	0.17	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	1'700	0	0	1'700 EUR	98.33%	1'597'630.76	0.23	a)
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	2'100	0	0	2'100 EUR	99.09%	1'988'757.41	0.29	a)
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	2'220	0	2'220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	1'500	0	0	1'500 EUR	98.91%	1'417'989.17	0.21	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	2'300	0	2'300 EUR	95.36%	2'096'213.59	0.30	a)
BE0002922038	3.2500 % WALLOO 3 1/4 06/22/33 EMTN	0	3'700	1'700	2'000 EUR	97.53%	1'864'331.04	0.27	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	0	2'000 EUR	90.28%	1'725'748.21	0.25	a)
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	2'500	0	0	2'500 EUR	95.37%	2'278'684.18	0.33	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	0	2'700	0	2'700 EUR	100.70%	2'598'649.02	0.38	a)
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	3'100	1'600	1'500 EUR	99.16%	1'421'558.87	0.21	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	3'500	0	0	3'500 EUR	84.62%	2'830'559.27	0.41	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	2'500	0	1'000	1'500 EUR	51.55%	739'071.84	0.11	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	1'000	0	0	1'000 EUR	95.13%	909'170.33	0.13	a)
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	0	12'000	12'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	0	8'000	0	8'000 EUR	91.98%	7'032'744.59	1.02	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	4'000	3'000	0	7'000 EUR	89.48%	5'986'530.17	0.87	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'200	0	0	2'200 EUR	94.11%	1'978'748.86	0.29	a)
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	3'350	0	3'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V5C3	5.3750 % DB 5 3/8 01/11/29	2'600	0	1'000	1'600 EUR	101.96%	1'559'100.91	0.23	a)
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	0	2'100	0	2'100 EUR	99.00%	1'987'011.26	0.29	a)
DE000A30VHW7	1.5000 % NIESA 1 1/2 10/17/29	1'200	0	0	1'200 EUR	91.23%	1'046'332.93	0.15	a)
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	0	2'000	0	2'000 EUR	98.78%	1'888'167.29	0.27	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	2'000	1'500	0	3'500 EUR	98.93%	3'309'243.52	0.48	a)
DE000A351U49	5.8240 % ALVGR 5.824 07/25/53	0	2'100	0	2'100 EUR	103.86%	2'084'474.19	0.30	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	78.94%	754'502.32	0.11	a)
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3.7 05/30/31 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000LB2CNE0	0.3750 % LBBW 0 3/8 09/30/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	675	0	675	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0NP7	3.0000 % NRW 3 01/27/28	1'000	0	0	1'000 EUR	99.46%	950'601.82	0.14	a)
DE000NWB0AL1	0.0000 % NRW BK 0 02/03/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	79.45%	1'518'753.23	0.22	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	3'000	0	0	3'000 EUR	89.41%	2'563'448.02	0.37	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	1'600	0	0	1'600 EUR	98.64%	1'508'438.84	0.22	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	3'700	1'300	2'500	2'500 EUR	97.53%	2'330'413.81	0.34	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	4'500	1'500	3'000 EUR	100.83%	2'891'057.85	0.42	a)
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	1'000	0	0	1'000 EUR	74.72%	714'131.71	0.10	a)
ES0000101012	1.7230 % MADRID 1.723 04/30/32	1'000	0	0	1'000 EUR	85.83%	820'295.72	0.12	a)
ES0200002089	3.9000 % ADIFAL 3.9 04/30/33 EMTN	0	1'700	1'000	700 EUR	100.70%	673'670.30	0.10	a)
EU000A1G30R0	3.3750 % EU 3 3/8 04/04/38 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	100.70%	2'887'158.42	0.42	a)
EU000A3K4D09	2.7500 % EU 2 3/4 12/04/37 SURE	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DS6	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	0	3'000	0	3'000 EUR	95.82%	2'747'438.24	0.40	a)
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	1'350	1'350	0 EUR	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EA2	0.0000 % EUB 0 01/12/24 6M	0	6'000	0	6'000 EUR	98.37%	5'640'933.24	0.82	a)
EU000A3K7MW2	1.6250 % EU 1 5/8 12/04/29 NGEU	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	0	3'000	0	3'000 EUR	54.23%	1'554'784.77	0.23	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	88.90%	1'529'381.10	0.22	a)
FR0014003067	0.0000 % IDF 0 04/20/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	79.50%	759'835.37	0.11	a)
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	51.42%	491'462.54	0.07	a)
FR0014009HA0	2.5000 % BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400A3H2	1.5000 % CADES 1 1/2 05/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	87.60%	1'172'097.34	0.17	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	2'450	0	0	2'450 EUR	92.21%	2'159'163.65	0.31	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CVE3	2.7500 % CADES 2 3/4 11/25/32 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	1'300	0	0	1'300 EUR	98.84%	1'228'016.95	0.18	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F0V4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F5U5	3.0000 % CADES 3 05/25/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FDB0	4.2500 % EDF 4 1/4 01/25/32 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	1'400	0	1'400 EUR	91.54%	1'224'842.92	0.18	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	1'500	0	1'500 EUR	99.86%	1'431'608.52	0.21	a)
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	0	3'000	1'200	1'800 EUR	98.98%	1'702'791.24	0.25	a)
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	0	3'000	0	3'000 EUR	100.01%	2'867'575.23	0.42	a)
IE000GVLBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	900	0	0	900 EUR	96.57%	830'665.54	0.12	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	2'000	0	0	2'000 EUR	79.65%	1'522'499.75	0.22	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	8'000	2'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	2'500	5'000	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	1'000	0	0	1'000 EUR	100.65%	961'965.61	0.14	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	0	3'000	0	3'000 EUR	101.10%	2'898'777.22	0.42	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	3'200	1'200	2'000 EUR	101.00%	1'930'601.36	0.28	a)
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	0	2'700	1'000	1'700 EUR	100.48%	1'632'481.95	0.24	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	0	3'000	0	3'000 EUR	97.24%	2'788'095.58	0.40	a)
PTEDPUOM0008	3.8750 % EDPLP 3 7/8 06/26/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	100.39%	1'055'428.64	0.15	a)
PTOTEPOE0032	1.1500 % PGB 1.15 04/11/42	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTEYOE0031	1.6500 % PGB 1.65 07/16/32	2'000	0	0	2'000 EUR	88.18%	1'685'549.62	0.24	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	0	1'600	0	1'600 EUR	98.45%	1'505'533.38	0.22	a)
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1578127778	1.4500 % TMO 1.45 03/16/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1797138960	2.6250 % IBESM 2 5/8 PERP EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	74.24%	709'534.58	0.10	a)
XS2018637327	1.1250 % HEIGR 1 1/8 12/01/27 EMTN	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	0	1'500	0	1'500 EUR	79.47%	1'139'236.96	0.17	a)
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	89.08%	851'405.18	0.12	a)
XS2177013765	0.7500 % RKTLLN 0 3/4 05/19/30 REGS	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193666042	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 06/23/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	84.84%	810'872.09	0.12	a)
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'300	0	0	1'300 EUR	89.98%	1'117'946.81	0.16	a)
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	1'800	0	0	1'800 EUR	78.84%	1'356'366.64	0.20	a)
XS2235996217	0.0000 % NOVNVX 0 09/23/28	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	1'000	0	0	1'000 EUR	78.31%	748'481.14	0.11	a)
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	0	4'000	2'000	2'000 EUR	74.93%	1'432'277.54	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2347663507	0.3750 % AZN 0 3/8 06/03/29 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2358287238	0.0100 % UBS 0.01 06/29/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	88.79%	1'272'907.27	0.18	a)
XS2366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'300	0	0	1'300 EUR	79.47%	987'388.39	0.14	a)
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404214020	0.9000 % PG 0.9 11/04/41	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2407197545	0.2500 % AUCCCN 0 1/4 11/17/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	77.55%	741'160.14	0.11	a)
XS2432130610	2.0000 % TTEFP 2 PERP	2'000	0	1'000	1'000 EUR	88.07%	841'694.82	0.12	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	88.58%	1'777'855.35	0.26	a)
XS2433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	89.50%	2'138'381.00	0.31	a)
XS2435663393	0.2500 % KUNTA 0 1/4 02/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	78.73%	1'053'453.22	0.15	a)
XS2461234622	1.9630 % JPM 1.963 03/23/30 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	87.01%	1'247'417.59	0.18	a)
XS2475954900	1.3750 % KFW 1 3/8 06/07/32	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2482618464	2.5000 % NDASS 2 1/2 05/23/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2485162163	2.2500 % EVKGR 2 1/4 09/25/27 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27	1'700	0	0	1'700 EUR	93.47%	1'518'585.98	0.22	a)
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2524746687	4.1250 % INTNED 4 1/8 08/24/33	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2532681074	3.7500 % FERROV 3 3/4 04/14/27 EMTN	1'550	0	1'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	1'050	0	1'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2539371653	3.3000 % ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS	2'500	0	1'000	1'500 EUR	98.42%	1'410'921.45	0.20	a)
XS2547290432	2.5000 % DENK 2 1/2 11/18/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2552369469	4.6250 % REESM 4 5/8 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2554581830	7.0000 % ASRND 7 12/07/43	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 EUR	98.85%	1'228'190.89	0.18	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	1'000	2'000	1'000	2'000 EUR	97.30%	1'859'877.28	0.27	a)
XS2574870759	3.5000 % MOTOPG 3 1/2 07/17/31 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575971994	4.0000 % ABNAV 4 01/16/28 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576298991	2.8750 % COE 2 7/8 01/17/33 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2580271596	3.8750 % PLD 3 7/8 01/31/30 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2584643113	3.6250 % NDASS 3 5/8 02/10/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2585932275	3.5530 % BDX 3.553 09/13/29	0	1'500	0	1'500 EUR	98.50%	1'412'125.68	0.21	a)
XS2587748174	2.7500 % RENTEN 2 3/4 02/16/32 EMTN	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2589907653	5.5000 % CS 5 1/2 08/20/26 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2590268814	3.0000 % KUNTA 3 09/25/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	99.39%	1'044'915.56	0.15	a)
XS2590764713	3.0000 % BNG 3 02/23/28 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592088400	3.3550 % ROSW 3.355 02/27/35	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592659671	4.2500 % VFC 4 1/4 03/07/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	99.02%	1'419'609.16	0.21	a)
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596458591	4.2500 % BXBAAU 4 1/4 03/22/31 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596599063	4.6990 % NWG 4.699 03/14/28 EMTN	0	1'300	550	750 EUR	100.26%	718'692.99	0.10	a)
XS2597093009	4.0500 % TOYOTA 4.05 09/13/29 EMTN	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	0	2'050	2'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597696124	4.0000 % DNBNO 4 03/14/29 EMTN	0	2'350	1'000	1'350 EUR	100.49%	1'296'614.97	0.19	a)
XS2597740476	4.1090 % NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN	0	1'150	1'150	0 EUR	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2611177382	3.1000 % IBRD 3.1 04/14/38 GMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	97.67%	2'147'036.21	0.31	a)
XS2613209670	4.3750 % SYDAU 4 3/8 05/03/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	99.68%	952'685.34	0.14	a)
XS2613658710	4.3750 % ABNAV 4 3/8 10/20/28	0	2'700	1'200	1'500 EUR	100.45%	1'440'110.00	0.21	a)
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	0	1'825	0	1'825 EUR	98.76%	1'722'551.48	0.25	a)
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618499177	3.7500 % SHBASS 3 3/4 05/05/26 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	99.37%	1'519'556.06	0.22	a)
XS2619751576	3.8750 % SEB 3 7/8 05/09/28 EMTN	0	3'050	1'550	1'500 EUR	99.85%	1'431'508.17	0.21	a)
XS2623518821	4.7710 % NWG 4.771 02/16/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	99.98%	2'388'857.53	0.35	a)
XS2624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	0	800	0	800 EUR	98.44%	752'690.23	0.11	a)
XS2625196352	4.8750 % ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	1'400	0	1'400 EUR	102.01%	1'364'868.93	0.20	a)
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	2'800	1'000	1'800 EUR	100.76%	1'733'378.86	0.25	a)
XS2626022573	4.1250 % WPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	99.32%	1'139'128.00	0.17	a)
XS2631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	99.32%	1'518'745.58	0.22	a)
XS2631835332	3.5000 % STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	99.52%	1'426'662.54	0.21	a)
XS2634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	0	3'400	1'500	1'900 EUR	99.00%	1'797'753.94	0.26	a)
XS2637069357	6.7500 % ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	101.80%	1'556'700.08	0.23	a)
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	1'400	0	1'400 EUR	101.65%	1'360'145.65	0.20	a)
XS2644969698	5.1250 % O 5 1/8 07/06/34	0	1'200	0	1'200 EUR	102.62%	1'176'906.64	0.17	a)
EUR							164'043'867.49	23.83	
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FNA1	4.0000 % BPIFRA 4 01/30/26 EMTN	0	400	0	400 GBP	96.14%	428'903.36	0.06	a)
GB00BFMCM652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	1'500	0	0	1'500 GBP	48.18%	806'050.83	0.12	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	1'400	0	1'400 GBP	97.08%	1'515'839.55	0.22	a)
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	2'900	1'000	700	3'200 GBP	72.50%	2'587'571.52	0.38	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'900	1'000	0	3'900 GBP	52.01%	2'262'329.39	0.33	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	1'000	900	0	1'900 GBP	30.73%	651'209.22	0.09	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	5'000	1'000	1'400	4'600 GBP	72.06%	3'697'059.72	0.54	a)
XS0295479983	4.5000 % EIB 4 1/2 03/07/44 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	97.36%	1'085'898.92	0.16	a)
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	700	0	0	700 GBP	77.36%	603'998.30	0.09	a)
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	700	0	0	700 GBP	80.02%	624'773.60	0.09	a)
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	500	0	0	500 GBP	91.38%	509'595.44	0.07	a)
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	400	0	400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	1'000	0	500	500 GBP	80.50%	448'899.04	0.07	a)
XS2251337353	1.1250 % VZ 1 1/8 11/03/28	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	0	0	1'000 GBP	80.31%	895'678.96	0.13	a)
XS2297626645	0.8750 % FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN	700	0	0	700 GBP	88.39%	690'097.52	0.10	a)
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	800	0	0	800 GBP	91.95%	820'411.86	0.12	a)
XS2384533563	1.6250 % ICBCAS 1 5/8 12/28/25 GMTN	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	900	0	0	900 GBP	40.51%	406'659.17	0.06	a)
XS2476782631	2.1250 % NRW 2 1/8 06/13/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	93.65%	1'566'830.32	0.23	a)
XS2507889835	2.7500 % IFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	94.68%	2'112'038.33	0.31	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	1'700	0	1'700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2540612129	6.3750 % NWG 6 3/8 11/08/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	100.66%	1'459'443.87	0.21	a)
XS2556930696	4.2500 % KOMMUN 4 1/4 11/17/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2590262296	5.1250 % ABNAV 5 1/8 02/22/28 EMTN	0	2'100	600	1'500 GBP	95.95%	1'605'259.10	0.23	a)
XS2592761527	4.3750 % CPPIBC 4 3/8 03/02/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	97.31%	1'085'307.80	0.16	a)
XS2598063480	6.5000 % ISPIM 6 1/2 03/14/29 EMTN	0	1'200	1'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GBP							25'863'855.82	3.76	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	95.69%	1'751'399.35	0.25	a)
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	98.90%	1'206'793.29	0.18	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	1'200'000	0	200'000	1'000'000 JPY	98.87%	6'031'953.07	0.88	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	750'000	0	0	750'000 JPY	98.55%	4'509'642.38	0.65	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	320'000	180'000	500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1120231J51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/28 23	600'000	0	300'000	300'000 JPY	111.65%	2'043'494.84	0.30	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	1'030'000	200'000	130'000	1'100'000 JPY	92.41%	6'201'802.71	0.90	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	600'000	300'000	0	900'000 JPY	94.13%	5'168'428.22	0.75	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	900'000	0	0	900'000 JPY	102.04%	5'602'933.11	0.81	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	800'000	0	0	800'000 JPY	85.77%	4'186'553.46	0.61	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	520'000	0	120'000	400'000 JPY	85.52%	2'087'029.16	0.30	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	300'000	0	0	300'000 JPY	110.92%	2'030'233.65	0.29	a)
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	0	300'000	0	300'000 JPY	100.08%	1'831'806.27	0.27	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	460'000	0	0	460'000 JPY	105.14%	2'950'843.24	0.43	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	940'000	0	0	940'000 JPY	125.69%	7'208'124.86	1.05	a)
XS0171578502	1.0500 % DBJP 1.05 06/20/23 INTL	225'000	0	225'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	400'000	0	200'000	200'000 JPY	104.61%	1'276'487.70	0.19	a)
XS0257403278	2.3000 % DBJP 2.3 03/19/26 INTL	540'000	0	0	540'000 JPY	105.50%	3'475'828.75	0.50	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	108.57%	662'417.30	0.10	a)
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	0	0	600'000 JPY	100.01%	3'660'867.03	0.53	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.55%	2'429'449.54	0.35	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	96.92%	1'773'883.18	0.26	a)
XS2548076301	1.0540 % TMO 1.054 10/20/27	200'000	0	0	200'000 JPY	99.76%	1'217'262.85	0.18	a)
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	0	400'000	0	400'000 JPY	100.06%	2'442'017.89	0.35	a)
XS2634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	0	340'000	0	340'000 JPY	100.04%	2'075'279.59	0.30	a)
JPY							71'824'531.44	10.43	
KR103502GD31	3.2500 % KTB 3 1/4 03/10/53 5303	0	4'000'000	0	4'000'000 KRW	92.30%	2'510'950.13	0.36	a)
KRW							2'510'950.13	0.36	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	350'000	0	0	350'000 MXN	98.83%	1'795'136.06	0.26	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	0	450'000	0	450'000 MXN	91.44%	2'135'649.59	0.31	a)
MXN							3'930'785.65	0.57	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	2'000	0	2'000	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	0	12'000	0	12'000 MYR	97.73%	2'254'640.57	0.33	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200 MYR	100.35%	38'582.42	0.01	a)
MYR							2'293'222.99	0.33	
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	12'600	0	0	12'600 NOK	99.97%	1'079'318.36	0.16	a)
NOK							1'079'318.36	0.16	
NZ1IBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	1'200	0	0	1'200 NZD	123.61%	800'230.73	0.12	a)
NZD							800'230.73	0.12	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	3'000	0	0	3'000 PLN	102.39%	666'575.67	0.10	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	3'000	0	0	3'000 PLN	92.46%	601'929.74	0.09	a)
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	2'500	0	0	2'500 PLN	98.33%	533'475.37	0.08	a)
PLN							1'801'980.78	0.26	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000 SEK	110.25%	454'750.81	0.07	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	6'200	0	0	6'200 SEK	99.41%	508'486.52	0.07	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	5'000	0	0	5'000 SEK	93.93%	387'465.26	0.06	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	0	0	5'000 SEK	82.81%	341'583.88	0.05	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	10'000	0	0	10'000 SEK	84.73%	699'032.17	0.10	a)
SEK							2'391'318.64	0.35	
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	400	0	400	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	400	0	0	400 SGD	102.77%	268'372.27	0.04	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	0	500	0	500 SGD	99.29%	324'105.80	0.05	a)
SGD							592'478.07	0.09	
TH0623035605	0.9500 % THAIGB 0.95 06/17/25	40'000	0	0	40'000 THB	97.68%	989'556.05	0.14	a)
TH0623038302	5.6700 % THAIGB 5.67 03/13/28	9'000	0	0	9'000 THB	114.41%	260'773.06	0.04	a)
THB							1'250'329.11	0.18	
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	88.43%	1'533'180.26	0.22	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	2'100	0	0	2'100 USD	99.53%	1'811'774.58	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	2'000	0	0	2'000 USD	90.56%	1'569'969.37	0.23	a)
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	0	1'500	0	1'500 USD	89.93%	1'169'311.30	0.17	a)
US00774MAW55	3.0000 % AER 3 10/29/28	1'500	0	0	1'500 USD	87.21%	1'133'943.82	0.16	a)
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	1'000	0	0	1'000 USD	99.45%	862'108.33	0.13	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAH05	0.4500 % GOOGL 0.45 08/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BQ82	0.8000 % AMZN 0.8 06/03/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02343UAJ43	5.6250 % AMCR 5 5/8 05/26/33	0	950	0	950 USD	99.81%	821'975.78	0.12	a)
US025816BW85	3.7000 % AXP 3.7 08/03/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAX84	2.7500 % AMT 2 3/4 01/15/27	1'500	0	0	1'500 USD	91.63%	1'191'389.97	0.17	a)
US031162BY57	3.1250 % AMGN 3 1/8 05/01/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	1'000	0	0	1'000 USD	82.93%	718'852.70	0.10	a)
US031162CZ14	2.0000 % AMGN 2 01/15/32	1'450	0	0	1'450 USD	79.06%	993'667.99	0.14	a)
US035240AL43	4.0000 % ABIBB 4 04/13/28	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	650	0	0	650 USD	93.05%	524'292.55	0.08	a)
US036752AX13	6.1000 % ELV 6.1 10/15/52	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AT77	4.4500 % AAPL 4.45 05/06/44	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	2'000	0	0	2'000 USD	62.93%	1'090'948.06	0.16	a)
US045167FP34	3.1250 % ASIA 3 1/8 08/20/27 GMTN	3'900	0	0	3'900 USD	95.36%	3'223'816.02	0.47	a)
US05723KAF75	4.0800 % BHI 4.08 12/15/47	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	800	4'800	0	5'600 USD	87.70%	4'257'225.18	0.62	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	0	1'500	0	1'500 USD	91.97%	1'195'810.91	0.17	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	85.84%	744'069.37	0.11	a)
US06051GKB40	2.9720 % BAC 2.972 07/21/52	1'500	0	800	700 USD	68.48%	415'508.94	0.06	a)
US06051GLA57	4.8270 % BAC 4.827 07/22/26 MTN	3'500	0	0	3'500 USD	98.85%	2'998'993.27	0.44	a)
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	2'950	0	1'450	1'500 USD	102.85%	1'337'371.85	0.19	a)
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	0	500	0	500 USD	99.19%	429'927.26	0.06	a)
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06368FAC32	1.2500 % BMO 1 1/4 09/15/26 MTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06407F2C54	1.0000 % BZLNZ 1 03/03/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06407F2E11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	1'650	0	0	1'650 USD	90.31%	1'291'749.10	0.19	a)
US06417XAD30	1.9500 % BNS 1.95 02/02/27	1'500	0	0	1'500 USD	89.55%	1'164'396.26	0.17	a)
US06675GAY17	1.6040 % BFCM 1.604 10/04/26 REGS	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EAU91	4.3370 % BACR 4.337 01/10/28	0	2'000	0	2'000 USD	94.77%	1'643'096.84	0.24	a)
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	0	700	0	700 USD	99.42%	603'257.39	0.09	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	1'150	0	0	1'150 USD	80.81%	805'596.65	0.12	a)
US10112RBB96	3.4000 % BXP 3.4 06/21/29	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122CQ99	4.1250 % BMV 4 1/8 06/15/39	300	0	0	300 USD	89.89%	233'766.04	0.03	a)
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	1'500	0	0	1'500 USD	89.58%	1'164'786.35	0.17	a)
US126650DE72	2.6250 % CVS 2 5/8 08/15/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	1'300	0	1'300 USD	99.41%	1'120'290.07	0.16	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	1'000	0	1'000 USD	98.30%	852'148.22	0.12	a)
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	2'050	0	0	2'050 USD	96.37%	1'712'535.86	0.25	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	0	2'430	2'430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	900	0	0	900 USD	90.78%	708'249.39	0.10	a)
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	1'250	0	0	1'250 USD	80.89%	876'450.36	0.13	a)
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	2'000	0	0	2'000 USD	75.34%	1'306'169.58	0.19	a)
US172967MF56	3.3520 % C 3.352 04/24/25	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967NX53	5.6100 % C 5.61 09/29/26	1'500	0	0	1'500 USD	99.77%	1'297'336.38	0.19	a)
US191216DP21	2.2500 % KO 2 1/4 01/05/32	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	800	0	800	0 USD	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	2'900	0	0	2'900 USD	79.15%	1'989'724.15	0.29	a)
US20271RAQ39	5.0790 % CBAAU 5.079 01/10/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	2'050	0	0	2'050 USD	98.28%	1'746'406.29	0.25	a)
US22535EAG26	5.5140 % ACAFP 5.514 07/05/33 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	100.84%	1'748'228.41	0.25	a)
US22822VBC46	5.1000 % CCI 5.1 05/01/33	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EWK18	4.1500 % DE 4.15 09/15/27 MTN	1'500	0	0	1'500 USD	97.75%	1'270'953.80	0.18	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CQ02	4.1620 % DB 4.162 05/13/25	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	118.50%	1'027'217.25	0.15	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	650	0	0	650 USD	92.44%	520'878.03	0.08	a)
US25243YBE86	2.1250 % DGELN 2 1/8 04/29/32	1'100	0	0	1'100 USD	81.14%	773'717.37	0.11	a)
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	750	0	0	750 USD	80.73%	524'843.00	0.08	a)
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	650	0	0	650 USD	95.65%	538'959.22	0.08	a)
US29250NBH70	1.6000 % ENBCN 1.6 10/04/26	500	0	0	500 USD	89.61%	388'374.81	0.06	a)
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAP37	2.2500 % ENELIM 2 1/4 07/12/31 144A	2'000	0	0	2'000 USD	79.21%	1'373'229.10	0.20	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	2'110	0	0	2'110 USD	89.48%	1'636'655.36	0.24	a)
US298785JT41	3.2500 % EIB 3 1/4 11/15/27	1'650	0	0	1'650 USD	95.89%	1'371'574.28	0.20	a)
US298785JU14	3.8750 % EIB 3 7/8 03/15/28	1'400	0	0	1'400 USD	98.19%	1'191'611.89	0.17	a)
US298785JV96	3.7500 % EIB 3 3/4 02/14/33	0	950	0	950 USD	97.41%	802'178.66	0.12	a)
US29881WAD48	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 144A	0	1'500	0	1'500 USD	91.06%	1'184'082.43	0.17	a)
US30216BJU70	3.3750 % EDC 3 3/8 08/26/25	1'150	0	0	1'150 USD	97.02%	967'160.58	0.14	a)
US30303M8J41	4.4500 % META 4.45 08/15/52	0	1'500	0	1'500 USD	87.36%	1'135'907.24	0.16	a)
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	0	2'000	0	2'000 USD	110.74%	1'919'934.05	0.28	a)
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	1'200	0	200	1'000 USD	98.52%	854'011.95	0.12	a)
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	0	2'400	1'400	1'000 USD	102.82%	891'312.51	0.13	a)
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	1'400	400	1'000 USD	100.41%	870'412.75	0.13	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	1'250	0	0	1'250 USD	90.58%	981'447.57	0.14	a)
US38143UH71	3.7500 % GS 3 3/4 02/25/26	2'000	0	0	2'000 USD	96.01%	1'664'508.03	0.24	a)
US404280CL16	2.0130 % HSBC 2.013 09/22/28	300	0	0	300 USD	86.38%	224'640.71	0.03	a)
US404280DQ93	7.3360 % HSBC 7.336 11/03/26	1'400	0	0	1'400 USD	103.37%	1'254'500.12	0.18	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	2'450	0	1'000	1'450 USD	92.59%	1'163'730.96	0.17	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	1'000	0	0	1'000 USD	89.96%	779'783.59	0.11	a)
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	0	950	0	950 USD	100.11%	824'446.30	0.12	a)
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	0	1'800	0	1'800 USD	99.64%	1'554'634.80	0.23	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CF51	5.1250 % INTC 5 1/8 02/10/30	0	2'000	0	2'000 USD	100.75%	1'746'616.07	0.25	a)
US4581X0DN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	900	0	0	900 USD	92.01%	717'814.21	0.10	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	2'000	0	0	2'000 USD	86.08%	1'492'334.29	0.22	a)
US4581X0EF19	3.5000 % IADB 3 1/2 09/14/29	2'100	0	0	2'100 USD	96.20%	1'751'137.55	0.25	a)
US4581X0EH74	4.0000 % IADB 4 01/12/28	2'000	0	0	2'000 USD	98.67%	1'710'624.45	0.25	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	3'400	0	3'400 USD	94.95%	2'798'569.75	0.41	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	2'000	0	0	2'000 USD	91.45%	1'585'381.97	0.23	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	0	1'500	0	1'500 USD	90.94%	1'182'509.09	0.17	a)
US459058JX27	0.8750 % IBRD 0 7/8 07/15/26	2'300	0	0	2'300 USD	89.89%	1'792'246.18	0.26	a)
US459058JZ74	1.1250 % IBRD 1 1/8 09/13/28	1'600	0	0	1'600 USD	85.44%	1'184'963.15	0.17	a)
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	1'000	0	0	1'000 USD	83.04%	719'832.24	0.10	a)
US459058KJ14	3.1250 % IBRD 3 1/8 06/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.38%	826'766.86	0.12	a)
US459058KL69	3.6250 % IBRD 3 5/8 09/21/29	1'800	0	0	1'800 USD	96.86%	1'511'320.03	0.22	a)
US459058L07	2.1250 % IBRD 2 1/8 03/03/25 GDIF	0	2'500	0	2'500 USD	95.40%	2'067'480.59	0.30	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	3'800	0	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	2'900	0	2'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	1'300	0	0	1'300 USD	97.51%	1'098'867.60	0.16	a)
US465410BX58	2.3750 % ITALY 2 3/8 10/17/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410BZ07	4.0000 % ITALY 4 10/17/49	1'000	0	0	1'000 USD	74.79%	648'282.44	0.09	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	2'500	0	0	2'500 USD	99.17%	2'149'116.19	0.31	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	1'100	0	1'100	0 USD	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US46647PDE34	3.8450 % JPM 3.845 06/14/25	1'000	0	0	1'000 USD	98.17%	850'960.64	0.12	a)
US46647PDM59	5.5460 % JPM 5.546 12/15/25	3'000	0	0	3'000 USD	99.76%	2'594'334.69	0.38	a)
US478160CJ19	2.6250 % JNJ 2 5/8 01/15/25	825	0	825	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	1'100	0	0	1'100 USD	80.84%	770'799.55	0.11	a)
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	600	0	0	600 USD	86.52%	449'978.37	0.07	a)
US50064FAN42	3.8750 % KOREA 3 7/8 09/20/48	700	0	0	700 USD	87.74%	532'371.59	0.08	a)
US50066RAR75	1.7500 % KOROIL 1 3/4 04/18/25 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	93.84%	894'787.71	0.13	a)
US500769JT24	3.0000 % KFW 3 05/20/27	3'000	0	0	3'000 USD	94.91%	2'468'234.02	0.36	a)
US500769JU96	3.1250 % KFW 3 1/8 06/10/25	2'000	0	0	2'000 USD	96.60%	1'674'823.55	0.24	a)
US500769JW52	3.7500 % KFW 3 3/4 02/15/28	1'300	0	0	1'300 USD	97.62%	1'100'084.66	0.16	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	2'500	0	0	2'500 USD	86.23%	1'868'711.89	0.27	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	1'800	0	0	1'800 USD	91.91%	1'434'161.72	0.21	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	1'650	0	0	1'650 USD	82.57%	1'180'986.47	0.17	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	2'000	0	0	2'000 USD	90.26%	1'564'889.63	0.23	a)
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	3'000	0	0	3'000 USD	81.18%	2'111'204.51	0.31	a)
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	550	0	0	550 USD	67.38%	321'241.17	0.05	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	550	0	0	550 USD	95.41%	454'902.94	0.07	a)
US59217HEP82	1.5500 % MET 1.55 01/07/31 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	4'000	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	1'800	0	0	1'800 USD	89.47%	1'396'011.65	0.20	a)
US61747YEC57	1.5120 % MS 1.512 07/20/27 GMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	0	725	0	725 USD	100.08%	628'962.74	0.09	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	500	0	0	500 USD	88.61%	384'075.23	0.06	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	99.00%	4'290'690.79	0.62	a)
US65559D2E87	1.5000 % NDASS 1 1/2 09/30/26 REGS	2'800	0	0	2'800 USD	88.13%	2'139'170.82	0.31	a)
US66989HAN89	3.1000 % NOVNVX 3.1 05/17/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US676167CB35	0.3750 % OKB 0 3/8 09/17/25	1'500	0	0	1'500 USD	90.91%	1'182'067.00	0.17	a)
US676167CG22	4.6250 % OKB 4 5/8 11/03/25	1'300	0	0	1'300 USD	99.44%	1'120'571.79	0.16	a)
US683234AQ19	1.0500 % ONT 1.05 05/21/27	2'300	0	0	2'300 USD	87.60%	1'746'529.38	0.25	a)
US683234AU21	2.1250 % ONT 2 1/8 01/21/32 MTN	1'950	0	0	1'950 USD	84.40%	1'426'661.73	0.21	a)
US68329AAH14	1.2500 % ONTFFT 1 1/4 09/27/30 144A	2'000	0	0	2'000 USD	79.22%	1'373'350.46	0.20	a)
US68389XCN30	4.6500 % ORCL 4.65 05/06/30	0	2'400	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	94.49%	819'112.57	0.12	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	3'000	0	1'000	2'000 USD	86.36%	1'497'240.66	0.22	a)
US713448DY13	3.0000 % PEP 3 10/15/27	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	2'800	0	0	2'800 USD	89.44%	2'170'869.79	0.32	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XCG43	4.8750 % PLD 4 7/8 06/15/28	0	5'000	2'500	2'500 USD	99.51%	2'156'462.75	0.31	a)
US74340XCH26	5.1250 % PLD 5 1/8 01/15/34	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	900	0	0	900 USD	84.68%	660'659.33	0.10	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	1'500	0	0	1'500 USD	85.30%	1'109'186.59	0.16	a)
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	1'000	0	0	1'000 USD	82.16%	712'221.30	0.10	a)
US748148SD69	3.6250 % Q 3 5/8 04/13/28	0	3'100	0	3'100 USD	96.39%	2'590'306.43	0.38	a)
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	0	1'500	0	1'500 USD	96.94%	1'260'538.60	0.18	a)
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	1'500	0	0	1'500 USD	97.87%	1'272'618.15	0.18	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	90.05%	1'561'110.17	0.23	a)
US756109BS20	4.7000 % O 4.7 12/15/28	0	2'100	2'100	0 USD	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	97.01%	840'887.84	0.12	a)
US78015K7H17	1.1500 % RY 1.15 06/10/25 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	1'000	0	0	1'000 USD	89.63%	776'992.33	0.11	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	98.11%	850'492.54	0.12	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	0	2'800	0	2'800 USD	98.71%	2'395'917.92	0.35	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	900	0	0	900 USD	86.29%	673'235.59	0.10	a)
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	550	750	0	1'300 USD	66.81%	752'828.89	0.11	a)
US80282KBF21	6.4990 % SANUSA 6.499 03/09/29	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'850	0	0	2'850 USD	89.30%	2'206'250.71	0.32	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	93.63%	2'434'894.97	0.35	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87031CAE30	2.2500 % SEK 2 1/4 03/22/27 GMTN	1'800	0	0	1'800 USD	91.91%	1'434'021.29	0.21	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89153VAQ23	3.4550 % TTEFP 3.455 02/19/29	1'000	0	0	1'000 USD	93.40%	809'637.90	0.12	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FT00	3.2000 % UNP 3.2 05/20/41	0	3'000	0	3'000 USD	78.21%	2'033'994.18	0.30	a)
US912796ZD42	0.0000 % B 11/30/23	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZY88	0.0000 % B 01/25/24	0	3'500	0	3'500 USD	97.50%	2'958'200.88	0.43	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	3'000	0	1'000	2'000 USD	106.28%	1'842'598.03	0.27	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	3'500	2'000	1'500	4'000 USD	94.19%	3'265'857.38	0.47	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	5'000	3'000	0	8'000 USD	86.19%	5'976'930.75	0.87	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	7'000	2'000	3'000	6'000 USD	80.73%	4'199'075.84	0.61	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	0	2'500	0	2'500 USD	81.77%	1'771'963.19	0.26	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	6'000	0	0	6'000 USD	72.17%	3'753'731.65	0.55	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	8'500	0	0	8'500 USD	92.41%	6'808'700.41	0.99	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	0	10'000	5'500	4'500 USD	95.44%	3'722'849.86	0.54	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	0	5'000	0	5'000 USD	79.78%	3'457'918.83	0.50	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	0	4'000	0	4'000 USD	91.23%	3'163'460.89	0.46	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	2'900	0	0	2'900 USD	86.13%	2'165'066.23	0.31	a)
US91282CEJ62	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	100.01%	1'733'851.43	0.25	a)
US91324PDX78	2.0000 % UNH 2 05/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	83.98%	728'015.30	0.11	a)
US91324PEE88	3.0500 % UNH 3.05 05/15/41	0	2'500	0	2'500 USD	76.29%	1'653'299.66	0.24	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	500	0	0	500 USD	70.25%	304'476.73	0.04	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAM47	2.0500 % V 2.05 04/15/30	2'100	0	0	2'100 USD	85.27%	1'552'278.70	0.23	a)
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	380	0	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	1'450	0	0	1'450 USD	94.97%	1'193'746.50	0.17	a)
US95000U2S19	2.3930 % WFC 2.393 06/02/28 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	89.46%	1'550'933.35	0.23	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	2'500	0	0	2'500 USD	85.93%	1'862'210.51	0.27	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	1'000	0	0	1'000 USD	104.23%	903'552.43	0.13	a)
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	850	0	0	850 USD	89.83%	661'909.76	0.10	a)
USC68012AA85	2.5000 % OMERFT 2 1/2 05/02/24 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	97.62%	1'692'368.59	0.25	a)
USF0803NAC68	4.5240 % BFCM 4.524 07/13/25 REGS	1'980	0	0	1'980 USD	97.67%	1'676'406.07	0.24	a)
USF2893TAC02	6.9500 % EDF 6.95 01/26/39 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	106.19%	1'472'854.43	0.21	a)
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	0	650	0	650 USD	100.82%	568'072.81	0.08	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	88.98%	1'156'984.70	0.17	a)
USG6594TAC79	2.3320 % NAB 2.332 08/21/30 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH4209CT27	2.7460 % UBS 2.746 02/11/33 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	79.55%	1'034'420.77	0.15	a)
USH4209DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH4209UAC02	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	1'350	0	0	1'350 USD	89.78%	1'050'648.21	0.15	a)
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	96.59%	837'247.07	0.12	a)
USQ66511AB43	5.7500 % NCMAU 5 3/4 11/15/41 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	98.70%	1'283'384.43	0.19	a)
USU3644QAF29	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU5876JAE56	4.9500 % MBGGR 4.95 03/30/25 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BV72	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBF79	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 01/24/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51800010693	4.0000 % ADCBUH 4 03/29/23 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51865437930	3.8750 % STSP 3 7/8 08/28/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 USD	95.70%	1'078'436.82	0.16	a)
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	850	0	0	850 USD	92.30%	680'057.69	0.10	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	80.84%	700'778.88	0.10	a)
XS2224639802	0.6250 % JFM 0 5/8 09/02/25 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	90.81%	1'574'320.96	0.23	a)
XS2225366694	0.8500 % SEB 0.85 09/02/25 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	91.97%	1'594'414.54	0.23	a)
XS2233217558	1.7100 % EDPL 1.71 01/24/28 REGS	800	0	0	800 USD	85.72%	594'416.38	0.09	a)
XS2233264550	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	90.78%	1'259'082.29	0.18	a)
XS2249473724	0.6250 % KOLAHO 0 5/8 11/03/23 GMTN	400	0	0	400 USD	98.68%	342'149.16	0.05	a)
XS2270152098	0.5000 % LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 USD	90.35%	2'428'024.31	0.35	a)
XS2280635256	1.6380 % EBIUH 1.638 01/13/26	3'000	0	0	3'000 USD	91.48%	2'379'009.15	0.35	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	78.94%	1'368'513.43	0.20	a)
XS2297244878	0.6250 % IDBINV 0 5/8 02/10/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 USD	89.86%	2'180'966.86	0.32	a)
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	90.25%	1'173'524.19	0.17	a)
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	90.59%	1'099'427.59	0.16	a)
XS2343566662	0.8750 % BNG 0 7/8 05/18/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	89.86%	1'557'850.81	0.23	a)
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	88.46%	1'533'683.03	0.22	a)
XS2348714713	3.1270 % UCGIM 3.127 06/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	80.02%	1'040'441.05	0.15	a)
XS2396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 USD	85.89%	1'265'654.74	0.18	a)
XS2402074277	1.2500 % CADES 1 1/4 10/28/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	89.71%	1'944'106.17	0.28	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	84.85%	1'470'992.44	0.21	a)
XS2408003650	1.5380 % SWEDA 1.538 11/16/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	79.79%	1'037'502.43	0.15	a)
XS2427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	89.42%	1'240'205.76	0.18	a)
XS2481608029	3.0000 % RENTEN 3 05/21/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	92.91%	1'208'137.51	0.18	a)
XS2532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2580013386	4.3750 % FABUH 4 3/8 04/24/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 USD	97.23%	1'854'320.44	0.27	a)
XS2613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	0	3'000	1'500	1'500 USD	96.98%	1'261'019.70	0.18	a)
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	98.73%	1'198'213.81	0.17	a)
XS2625207571	5.3750 % BGOSK 5 3/8 05/22/33 REGS	0	800	0	800 USD	99.81%	692'169.32	0.10	a)

USD **269'703'373.92** **39.17**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen **37'096'269.98** **5.39**

IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	10'477'252	0	0	10'477'252 USD	4.08	37'096'269.98	5.39	a)
--------------	--------------------------	------------	---	---	----------------	------	---------------	------	----

USD **37'096'269.98** **5.39**

Nicht kotierte Wertpapiere **0.00** **0.00**

Strukturierte Produkte **0.00** **0.00**

CH0473236351	ZKB TRACKER DYN LS BOND F 2025	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
--------------	--------------------------------	-------	---	-------	-------	------	------	------	--

Diverse **0.00** **0.00**

Derivative Finanzinstrumente **39'225.72** **0.01**

Futures **0.00** **0.00**

03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	-200	430	230	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	120	120	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUXL 30Y BND MAR23	15	13	28	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR NOTE (CBT)MAR23	-200	410	210	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US ULTRA BOND CBT MAR23	220	25	245	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 5YR NOTE (CBT) MAR23	-140	140	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	820	820	0 EUR	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 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUXL 30Y BND JUN23	0	56	56	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR NOTE (CBT)JUN23	0	585	585	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US ULTRA BOND CBT JUN23	0	380	380	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 5YR NOTE (CBT) JUN23	0	390	390	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	120	190	-70 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	EURO-BUXL 30Y BND SEP23	0	45	18	27 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	US 10YR NOTE (CBT)SEP23	0	165	60	105 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	US ULTRA BOND CBT SEP23	0	258	30	228 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	US 5YR NOTE (CBT) SEP23	0	190	170	20 USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	US 2YR NOTE (CBT) SEP23	0	220	165	55 USD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall	23.02.2023	6'438'607	7'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	23.02.2023	4'000'000	3'705'836	USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	23.02.2023	4'528'560	5'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	24.02.2023	500'000'000	3'571'885	JPY/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.04.2023	3'674'980	4'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	20.04.2023	700'000'000	4'818'478	JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	20.04.2023	4'000'000	3'718'688	USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.04.2023	5'581'140	6'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.04.2023	7'937'992	8'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	20.04.2023	4'000'000	3'753'804	USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.04.2023	3'924'452	4'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.04.2023	3'661'240	4'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.04.2023	2'941'008	3'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	20.04.2023	1'713'190	250'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	20.04.2023	3'000'000	2'770'842	USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	20.04.2023	5'000'000	4'911'270	EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	20.04.2023	5'465'718	6'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	20.04.2023	3'000'000	2'989'053	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	20.04.2023	4'944'215	5'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall	21.04.2023	6'500'000'000	4'607'119	KRW/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall	21.04.2023	4'426'888	6'500'000'000	CHF/KRW	0.00	0.00	
CAD/AUD	Verfall	02.05.2023	443'478	400'000	AUD/CAD	0.00	0.00	
DKK/AUD	Verfall	02.05.2023	738'799	3'300'000	AUD/DKK	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	17.05.2023	8'045'271	9'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	17.05.2023	11'791'632	12'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	17.05.2023	450'000'000	3'013'043	JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	17.05.2023	4'000'000	3'940'252	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	17.05.2023	3'000'000	2'679'558	USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	17.05.2023	3'000'000	2'665'614	USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	13.07.2023	550'000'000	3'629'483	JPY/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	13.07.2023	8'746'353	9'000'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	13.07.2023	8'021'511	9'000'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	13.07.2023	4'300'000	3'902'783	USD/CHF	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	13.07.2023	4'005'771	6'600'000	CHF/AUD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	13.07.2023	1'600'000	1'439'078	USD/CHF	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall	13.07.2023	1'507'380	29'200'000	CHF/MXN	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	13.07.2023	7'800'000	4'750'676	AUD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	13.07.2023	2'447'758	2'500'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	13.07.2023	2'063'513	2'100'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	13.07.2023	2'800'000	1'902'415	CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	13.07.2023	1'800'000	1'617'174	USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	13.07.2023	4'196'972	4'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	13.07.2023	568'127	500'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	13.07.2023	1'710'319	1'900'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	13.07.2023	585'900'000	3'652'471	JPY/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	13.07.2023	2'225'465	2'500'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall	14.07.2023	8'000'000'000	5'428'930	KRW/CHF	0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall	14.07.2023	4'200'000'000	2'892'562	KRW/CHF	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall	14.07.2023	8'339'565	12'200'000'000	CHF/KRW	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	14.09.2023	565'451	500'000	CHF/GBP	10'299.44	0.00	b)
USD/CHF	Verfall	14.09.2023	4'999'812	5'700'000	CHF/USD	81'541.25	0.01	b)
CHF/CAD	Verfall	14.09.2023	2'800'000	1'853'765	CAD/CHF	-17'226.88	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall	14.09.2023	1'135'900'000	7'145'174	JPY/CHF	-199'367.32	-0.03	b)
MXN/CHF	Verfall	14.09.2023	1'483'112	29'200'000	CHF/MXN	-14'584.38	0.00	b)
CHF/AUD	Verfall	14.09.2023	1'200'000	704'395	AUD/CHF	-5'660.35	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall	14.09.2023	17'346'711	17'900'000	CHF/EUR	281'935.37	0.04	b)
USD/CHF	Verfall	14.09.2023	1'279'551	1'500'000	CHF/USD	-14'657.39	0.00	b)
CHF/CNY	Verfall	14.09.2023	32'100'000	3'898'802	CNY/CHF	-5'602.87	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall	14.09.2023	1'500'000	1'437'789	EUR/CHF	-7'812.01	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/IDR Verfall 14.09.2023		54'992'300'000	3'137'934		IDR/CHF	4'404.12	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 15.09.2023		12'200'000'000	8'322'930		KRW/CHF	-42'759.08	-0.01	b)
	KRW/USD Verfall 15.09.2023		3'087'482	3'970'900'000		USD/KRW	-31'284.18	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							39'225.72	0.01	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	9'067'802.31	1.32
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	637'583'322.76	92.60
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	37'096'269.98	5.39
Derivative Finanzinstrumente	39'225.72	0.01
Sonstige Vermögenswerte	4'749'510.04	0.69
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	688'536'130.81	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-90'964.07	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	688'445'166.74	

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);	674'679'592.74	97.99
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	39'225.72	0.01
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.58412687
CAD	1 = CHF	0.65857550
CNY	1 = CHF	0.12134723
DKK	100 = CHF	12.82455300
EUR	1 = CHF	0.95574372
GBP	1 = CHF	1.11533255
IDR	10'000 = CHF	0.57480000
JPY	100 = CHF	0.61011400
KRW	1 = CHF	0.00068007
MXN	1 = CHF	0.05189942
MYR	1 = CHF	0.19224884
NOK	100 = CHF	8.56867500
NZD	1 = CHF	0.53948410
PLN	1 = CHF	0.21700546
SEK	100 = CHF	8.24982200
SGD	1 = CHF	0.65284681
THB	100 = CHF	2.53252000
USD	1 = CHF	0.86685000
ZAR	1 = CHF	0.04874394

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	103'198'301.44	14.990
Netto-Gesamtingagement aus Derivaten	CHF	27'573'786.61	4.005
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DA CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	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, 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: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	0.950	1.200	0.750	0.200	4.000
BA CHF	0.580	0.900	0.380	0.200	4.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	4.000
DA CHF	0.450	0.700	0.350	0.100	4.000
GT CHF	0.380	0.600	0.280	0.100	4.000
NT CHF	-	-	-	-	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

Dieser Fonds 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 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.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens 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 aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Anlagefonds gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des Anlagefonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Anlagefonds 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 § 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 Nettofondsvermögens (Fondsvermögen 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 Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen, getätigt wurden.