

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE GLOBAL CORPORATE

Halbjahresbericht per 31.07.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AAH1 EUR	1748683	EUR
BAH1 EUR	20594687	EUR
CTH1 EUR	37873427	EUR
DAH1 EUR	47624911	EUR
GTH1 EUR	20594559	EUR
NT CHF	131373185	CHF
NTH1 CHF	132734854	CHF

Rechnungswährung: EUR

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 I	17
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
7	Pauschale Verwaltungskommission	18
8	Benchmark	19
9	TER	19
10	Fussnoten	19
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2024	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021
	bis	31.07.2024	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
Konsolidiert					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		121'055'317.79	67'847'497.11	47'823'862.75	43'158'488.97
Klasse AAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		26'913'620.84	28'774'000.47	32'163'915.04	29'936'518.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		250'601.036	267'020.066	308'480.512	256'629.831
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.3963	107.7597	104.2656	116.6525
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		107.3963	107.6304	104.1405	116.7692
Ausschüttung je Anteil		-	2.05	0.90	0.60
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		312'382.80	314'155.75	320'457.56	433'967.58
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'402.911	3'589.191	4'349.201
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.7987	92.3197	89.2841	99.7810
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.7987	92.2089	89.1769	99.8808
Ausschüttung je Anteil		-	2.15	1.10	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CTH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'245'577.48	5'829'470.74	6'646'053.63	559'852.78
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		54'149.778	60'784.456	72'292.551	5'478.942
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.8716	95.9040	91.9328	102.1826
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.8716	95.7889	91.8224	102.2848
Thesaurierung je Anteil		-	2.26	1.08	1.02
Total Expense Ratio (TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		674'132.87	678'677.71	974'209.67	2'776'936.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	7'525.321	11'167.953	28'424.642
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.5819	90.1859	87.2326	97.6947
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.5819	90.0777	87.1279	97.7924
Ausschüttung je Anteil		-	2.25	1.25	1.20
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %	0.44 %	0.38 %	0.38 %
Klasse GTH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'316'149.22	4'541'258.12	7'719'226.85	9'451'213.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		38'241.000	40'640.000	72'141.628	79'600.429
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		112.8671	111.7436	107.0010	118.7332
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		112.8671	111.6095	106.8726	118.8519
Thesaurierung je Anteil		-	2.85	1.54	1.52
Total Expense Ratio (TER)		0.43 %	0.35 %	0.30 %	0.30 %

Klasse NT CHF	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		26'811'872.07	27'709'934.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		243'524.557	258'886.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		104.8715	99.7395
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		104.8715	99.6198
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		-	0.13
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %

Klasse NTH1 CHF	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		56'781'582.51	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		535'592.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.9826	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.9826	
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AAH1 EUR	1.73 %	6.60 %	-13.10 %	-1.88 %
Klasse BAH1 EUR	1.95 %	7.05 %	-12.74 %	-1.47 %
Klasse CTH1 EUR	1.98 %	7.11 %	-12.68 %	-1.41 %
Klasse DAH1 EUR	1.89 %	7.24 %	-12.40 %	-1.23 %
Klasse GTH1 EUR	1.92 %	7.32 %	-12.32 %	-1.15 %
Klasse NT CHF (Lancierung 19.01.2024)	5.19 %	-	-	-
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 28.03.2024)	1.10 %	-	-	-

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)	31.07.2024	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	3'269'244.96	2'007'320.71
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	116'270'263.72	65'043'288.02
Sonstige Vermögenswerte	1'546'346.35	829'535.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	121'085'855.03	67'880'144.28
Andere Verbindlichkeiten	-30'537.24	-32'647.17
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	121'055'317.79	67'847'497.11

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse AAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		267'020.066	308'480.512
Ausgegebene Anteile		1'313.715	1'574.590
Zurückgenommene Anteile		-17'732.745	-43'035.036
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		250'601.036	267'020.066
Klasse BAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'402.911	3'589.191
Zurückgenommene Anteile		-	-186.280
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'402.911
Klasse CTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		60'784.456	72'292.551
Ausgegebene Anteile		633.000	886.095
Zurückgenommene Anteile		-7'267.678	-12'394.190
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		54'149.778	60'784.456
Klasse DAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'525.321	11'167.953
Zurückgenommene Anteile		-	-3'642.632
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	7'525.321
Klasse GTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		40'640.000	72'141.628
Ausgegebene Anteile		836.000	1'632.000
Zurückgenommene Anteile		-3'235.000	-33'133.628
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		38'241.000	40'640.000
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		258'886.000	-
Ausgegebene Anteile		48'566.557	259'229.000
Zurückgenommene Anteile		-63'928.000	-343.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		243'524.557	258'886.000
Klasse NTH1 CHF			
Ausgegebene Anteile		535'592.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		535'592.000	-

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		67'847'497.11	47'823'862.75
Ausbezahlte Ausschüttung		-553'286.83	-283'534.99
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-94'534.95	-65'443.89
Saldo aus dem Anteilverkehr		50'500'974.45	18'403'018.49
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		3'354'668.01	1'969'587.57
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		121'055'317.79	67'847'489.93

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		23'361.04	18'651.62
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-353.54	-20.99
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'192'820.02	1'289'392.88
Erträge aus Wertpapierleihe		0.00	6'880.47
Sonstige Erträge		1'056.68	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		106'934.59	7'802.70
Total Ertrag		2'323'818.79	1'322'706.68
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-0.05
Reglementarische Vergütungen		-170'436.65	-377'591.33
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-99'636.69	-83'866.05
Total Aufwand		-270'073.34	-461'457.43
Nettoertrag / Verlust		2'053'745.45	861'249.25
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		549'205.56	-5'060'218.11
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		74'530.26	44'311.16
Realisierter Erfolg		2'677'481.27	-4'154'657.70
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		677'186.74	6'124'245.27
Gesamterfolg		3'354'668.01	1'969'587.57

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							116'270'263.72	96.02	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							116'270'263.72	96.02	
AU3C80307387	5.6500 % TLSAU 5.65 03/06/34 MTN	0	800	0	800 AUD	102.66%	495'621.56	0.41	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.82%	263'469.00	0.22	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	150	400	0	550 EUR	103.98%	571'890.00	0.47	a)
XS2831094706	4.2660 % CBAAU 4.266 06/04/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.67%	305'022.00	0.25	a)
AU							1'636'002.56	1.35	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	200	0	0	200 EUR	107.40%	214'792.00	0.18	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	100	0	0	100 EUR	103.38%	103'378.00	0.09	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.33%	405'320.00	0.33	a)
BE6352762387	3.6250 % CCBGBB 3 5/8 06/11/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.53%	406'116.00	0.34	a)
BE							1'129'606.00	0.93	
CA07813ZCK80	5.8500 % BCECN 5.85 11/10/32	700	400	100	1'000 CAD	108.46%	725'543.56	0.60	a)
CA136375DG42	4.7000 % CNRCN 4.7 05/10/53	300	300	0	600 CAD	100.07%	401'638.82	0.33	a)
CA13645RAZ79	3.1500 % CP 3.15 03/13/29	400	0	0	400 CAD	96.78%	258'961.10	0.21	a)
CA44810ZCR97	4.3900 % HYDNE 4.39 03/01/34	0	200	0	200 CAD	101.39%	135'645.65	0.11	a)
CA775109DA61	5.9000 % RCICN 5.9 09/21/33	400	300	0	700 CAD	108.21%	506'723.87	0.42	a)
CA87971MCB78	5.6000 % TCN 5.6 09/09/30 CAM	500	300	0	800 CAD	106.20%	568'356.17	0.47	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	900	400	200	1'100 CAD	96.84%	712'569.82	0.59	a)
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	500	0	500 CHF	104.05%	546'189.44	0.45	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	400	0	0	400 USD	84.86%	313'701.47	0.26	a)
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	350	0	0	350 USD	94.01%	304'061.41	0.25	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	200	0	0	200 USD	100.89%	186'461.71	0.15	a)
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	300	600	0	900 USD	101.29%	842'446.15	0.70	a)
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	600	0	0	600 USD	83.55%	463'271.91	0.38	a)
US94106BAG68	5.0000 % WCNCN 5 03/01/34	0	300	0	300 USD	100.35%	278'198.25	0.23	a)
CA							6'243'769.33	5.16	
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	600	200	0	800 USD	99.28%	733'951.44	0.61	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	250	0	0	250 USD	103.80%	239'807.11	0.20	a)
USH42097EQ69	6.3010 % UBS 6.301 09/22/34 REGS	200	0	0	200 USD	106.44%	196'728.79	0.16	a)
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	200	200	0	400 USD	108.49%	401'039.15	0.33	a)
CH							1'571'526.49	1.30	
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	400	0	400 USD	102.66%	379'492.14	0.31	a)
CL							379'492.14	0.31	
DE000A14J9N8	2.2410 % ALVGR 2.241 07/07/45	300	0	0	300 EUR	98.42%	295'245.00	0.24	a)
DE000A3823H4	4.8510 % ALVGR 4.851 07/26/54	400	0	0	400 EUR	105.35%	421'388.00	0.35	a)
DE000A383J53	8.1250 % DB 8 1/8 PERP	0	200	0	200 EUR	101.86%	203'716.00	0.17	a)
DE000A3MQQV5	2.0000 % DBOERS 2 06/23/48	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000C245W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	300	0	0	300 EUR	98.90%	296'700.00	0.25	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	200	300	0	500 EUR	95.77%	478'860.00	0.40	a)
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	200	700	0	900 USD	86.66%	720'765.95	0.60	a)
USD5558XAA66	5.8750 % MUNRE 5 7/8 05/23/42 REGS	400	200	0	600 USD	100.89%	559'407.31	0.46	a)
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	200	200	0	400 USD	84.40%	311'989.98	0.26	a)
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	500	200	0	700 EUR	94.98%	664'874.00	0.55	a)
XS2056730679	3.6250 % IFXGR 3 5/8 PERP	200	0	0	200 EUR	97.27%	194'536.00	0.16	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	0	400	0	400 EUR	95.13%	380'500.00	0.31	a)
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	300	0	0	300 EUR	113.16%	339'483.00	0.28	a)
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	200	200	200	200 EUR	106.51%	213'024.00	0.18	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	400	300	0	700 EUR	103.25%	722'750.00	0.60	a)
DE							5'803'239.24	4.79	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DK0030393665	3.8750 % NYKRE 3 7/8 07/05/27 EMTN	0	900	0	900 EUR	101.40%	912'636.00	0.75	a)
DK							912'636.00	0.75	
ES0813211028	6.0000 % BBVASM 6 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0840609053	7.5000 % CABKSM 7 1/2 PERP	200	0	0	200 EUR	105.26%	210'514.00	0.17	a)
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAM36	9.3750 % BBVASM 9 3/8 PERP	200	200	0	400 USD	107.97%	399'120.66	0.33	a)
US05946KAN19	7.8830 % BBVASM 7.883 11/15/34	200	400	0	600 USD	112.05%	621'292.60	0.51	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	400	0	400 USD	101.92%	376'730.84	0.31	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	600	0	200	400 USD	92.88%	343'329.08	0.28	a)
US05964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	400	0	400 USD	101.00%	373'330.04	0.31	a)
US05964HBG92	5.4390 % SANTAN 5.439 07/15/31	0	400	0	400 USD	101.27%	374'350.28	0.31	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	200	0	0	200 USD	85.44%	157'920.88	0.13	a)
US05971KAQ22	9.6250 % SANTAN 9 5/8 PERP _	200	200	0	400 USD	114.14%	421'913.40	0.35	a)
XS2300292963	1.2500 % CLNXSM 1 1/4 01/15/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.11%	91'105.00	0.08	a)
XS2455392584	2.6250 % SABSM 2 5/8 03/24/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2465792294	2.2500 % CLNXSM 2 1/4 04/12/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2552369469	4.6250 % REESM 4 5/8 PERP	300	0	0	300 EUR	101.62%	304'860.00	0.25	a)
XS2580221658	4.8750 % IBESM 4 7/8 PERP EMTN	300	300	0	600 EUR	102.25%	613'500.00	0.51	a)
XS2674597468	8.2500 % BBVASM 8 1/4 11/30/33 EMTN	0	200	0	200 GBP	108.29%	257'089.69	0.21	a)
XS2726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	200	300	0	500 EUR	106.62%	533'120.00	0.44	a)
XS2782109016	4.2500 % SABSM 4 1/4 09/13/30 EMTN	0	900	0	900 EUR	102.82%	925'344.00	0.76	a)
XS2826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.68%	201'350.00	0.17	a)
ES							6'204'870.47	5.12	
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	500	0	500 CHF	103.72%	544'441.44	0.45	a)
FR0013428513	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 06/21/39 EMTN	100	0	0	100 EUR	71.49%	71'494.00	0.06	a)
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	200	300	0	500 EUR	89.60%	448'005.00	0.37	a)
FR0014002829	1.7950 % BNP 1.795 09/03/27 ENTN	0	600	0	600 AUD	92.64%	335'432.72	0.28	a)
FR0014005EJ6	1.0000 % BNFP 1 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 5 1/8 03/02/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	300	200	200	300 EUR	103.42%	310'266.00	0.26	a)
FR001400KCC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	300	200	0	500 EUR	104.94%	524'715.00	0.43	a)
FR001400KY44	4.1250 % BNP 4 1/8 09/26/32 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L461	6.6250 % SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN	100	100	0	200 GBP	109.67%	260'344.44	0.22	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFPP 5 1/4 11/22/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	103.83%	103'830.00	0.09	a)
FR001400N2U2	6.5000 % ACAFP 6 1/2 PERP EMTN	400	200	0	600 EUR	101.52%	609'102.00	0.50	a)
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	102.06%	102'062.00	0.08	a)
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	500	0	500 EUR	100.73%	503'650.00	0.42	a)
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	0	100	0	100 EUR	104.36%	104'359.00	0.09	a)
FR001400QOL3	5.1250 % ENGIFP 5 1/8 PERP	0	400	0	400 EUR	101.15%	404'584.00	0.33	a)
FR001400RIX8	4.8750 % CNPFP 4 7/8 07/16/54 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.26%	511'285.00	0.42	a)
US06675GBC87	5.0880 % BFCM 5.088 01/23/27 REGS	600	500	0	1'100 USD	100.41%	1'020'660.00	0.84	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	200	0	0	200 USD	102.99%	190'357.84	0.16	a)
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	300	300	0	600 USD	100.59%	557'743.88	0.46	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	200	300	0	500 USD	98.31%	454'274.58	0.38	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	200	0	0	200 USD	92.06%	170'156.36	0.14	a)
USF1067PAD80	9.2500 % BNP 9 1/4 PERP REGS	200	200	0	400 USD	107.50%	397'386.99	0.33	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	400	600	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF12033TP59	2.9470 % BNFP 2.947 11/02/26 REGS	500	0	0	500 USD	96.05%	443'818.05	0.37	a)
USF2R125Q730	6.2510 % ACAFP 6.251 01/10/35 REGS	400	550	0	950 USD	103.40%	907'808.02	0.75	a)
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.06%	99'055.00	0.08	a)
XS2610457967	5.5000 % AXASA 5 1/2 07/11/43 EMTN	400	0	0	400 EUR	108.58%	434'332.00	0.36	a)
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	350	200	0	550 EUR	103.67%	570'196.00	0.47	a)
FR							10'079'359.32	8.32	
US404280DV88	6.2540 % HSBC 6.254 03/09/34	400	300	0	700 USD	106.59%	689'527.59	0.57	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	300	0	0	300 USD	98.04%	271'799.57	0.22	a)
US53944YAZ60	5.4620 % LLOYDS 5.462 01/05/28	0	300	0	300 USD	100.96%	279'908.81	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US53944YBA01	5.7210 % LLOYDS 5.721 06/05/30	0	450	0	450 USD	102.81%	427'544.12	0.35	a)
US639057AL28	5.5830 % NWG 5.583 03/01/28	0	300	0	300 USD	101.26%	280'721.12	0.23	a)
US63906YAJ73	5.4100 % NWG 5.41 05/17/29 144A	0	400	0	400 USD	101.81%	376'357.49	0.31	a)
US92857WBX74	5.1250 % VOD 5 1/8 06/04/2081	400	0	0	400 USD	75.26%	278'185.31	0.23	a)
USG84228FQ64	6.3010 % STANLN 6.301 01/09/29 REGS	400	300	0	700 USD	103.63%	670'353.74	0.55	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	100	0	0	100 GBP	99.64%	118'274.93	0.10	a)
XS1083986718	3.8750 % AVLN 3 7/8 07/03/44 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057092236	2.2500 % SSELN 2 1/4 09/27/35 EMTN	200	0	0	200 GBP	76.55%	181'736.64	0.15	a)
XS2083961370	3.7500 % LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN	200	0	0	200 GBP	91.22%	216'563.18	0.18	a)
XS2113658202	5.7500 % NWIDE 5 3/4 PERP	200	0	0	200 GBP	95.13%	225'826.52	0.19	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	0	500	0	500 USD	90.07%	416'177.32	0.34	a)
XS2485268150	6.8750 % AVLN 6 7/8 PERP	200	0	0	200 GBP	96.65%	229'442.12	0.19	a)
XS2592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	200	500	0	700 EUR	106.19%	743'358.00	0.61	a)
XS2641168997	5.7500 % UU 5 3/4 06/26/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.30%	121'425.23	0.10	a)
XS2678308359	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 09/11/35 EMTN	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	106.44%	106'441.00	0.09	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	100	300	0	400 GBP	105.61%	501'416.77	0.41	a)
XS2741906809	5.3500 % NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN	300	300	0	600 GBP	98.69%	702'848.09	0.58	a)
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.45%	202'900.00	0.17	a)
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	200	0	0	200 GBP	102.43%	243'166.20	0.20	a)
XS2794589403	5.1250 % BRITEL 5 1/8 10/03/54 EMTN	0	550	0	550 EUR	101.76%	559'680.00	0.46	a)
GB							7'843'653.75	6.48	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	300	0	0	300 EUR	87.77%	263'310.00	0.22	a)
HK							263'310.00	0.22	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	600	300	0	900 USD	84.67%	704'173.20	0.58	a)
USG0R4HJAD89	6.6080 % AIB 6.608 09/13/29 REGS	200	700	0	900 USD	105.18%	874'783.31	0.72	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	300	0	0	300 USD	84.83%	235'192.93	0.19	a)
XS2528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	200	200	0	400 GBP	104.48%	496'080.03	0.41	a)
XS2560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	100	300	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE							2'310'229.47	1.91	
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	400	600	400	600 EUR	90.73%	544'392.00	0.45	a)
XS2437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	200	0	0	200 EUR	93.68%	187'350.00	0.15	a)
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	108.04%	324'114.00	0.27	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	200	300	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2678939427	9.1250 % ISPIM 9 1/8 PERP	200	200	0	400 EUR	112.05%	448'188.00	0.37	a)
XS2798269069	4.7500 % TRNIM 4 3/4 PERP	0	300	0	300 EUR	99.44%	298'305.00	0.25	a)
IT							1'802'349.00	1.49	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	400	0	0	400 USD	62.22%	230'004.87	0.19	a)
XS2839195877	4.2500 % APTV 4 1/4 06/11/36	0	300	0	300 EUR	101.89%	305'667.00	0.25	a)
JE							535'671.87	0.44	
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	200	0	0	200 USD	94.94%	175'481.20	0.14	a)
US606822CY81	5.2420 % MUFG 5.242 04/19/29	0	400	0	400 USD	101.42%	374'886.27	0.31	a)
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	200	0	0	200 USD	108.50%	200'530.67	0.17	a)
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	500	0	0	500 USD	102.49%	473'570.42	0.39	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	400	500	0	900 USD	103.44%	860'286.48	0.71	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	200	0	0	200 USD	86.34%	159'571.38	0.13	a)
US874060BL90	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/44	0	1'000	0	1'000 USD	100.23%	926'273.98	0.76	a)
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	101.64%	939'276.49	0.78	a)
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP							4'109'876.89	3.39	
USY555CGAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	200	0	200 USD	101.04%	186'738.95	0.15	a)
USY8085FBL32	6.5000 % HYUELE 6 1/2 01/17/33 REGS	400	300	0	700 USD	107.97%	698'428.81	0.58	a)
KR							885'167.76	0.73	
CH1210198136	3.2500 % SLHNX 3 1/4 08/31/29	200	200	0	400 EUR	99.93%	399'704.00	0.33	a)
LI							399'704.00	0.33	
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	400	0	0	400 EUR	90.40%	361'592.00	0.30	a)
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	400	0	0	400 EUR	83.30%	333'184.00	0.28	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.51%	100'506.00	0.08	a)
LU							795'282.00	0.66	
USP01703AD22	3.2500 % ALPEKA 3 1/4 02/25/31 REGS	300	300	0	600 USD	86.46%	479'390.59	0.40	a)
MX							479'390.59	0.40	
US456837BF96	6.0830 % INTNED 6.083 09/11/27	300	0	0	300 USD	102.03%	282'875.27	0.23	a)
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	1'000	0	1'000 USD	101.33%	936'448.65	0.77	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	500	300	0	800 USD	95.38%	705'125.98	0.58	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1693822634	4.7500 % ABNANV 4 3/4 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	300	0	0	300 EUR	94.32%	282'954.00	0.23	a)
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	100	0	0	100 EUR	99.50%	99'497.00	0.08	a)
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	300	0	0	300 EUR	81.44%	244'317.00	0.20	a)
XS2456432413	4.8750 % RABOBK 4 7/8 PERP	400	200	0	600 EUR	95.58%	573'468.00	0.47	a)
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	400	200	0	600 EUR	105.97%	635'802.00	0.53	a)
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	200	200	0	400 USD	101.66%	375'773.44	0.31	a)
XS2590262296	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN	200	200	0	400 GBP	101.21%	480'530.34	0.40	a)
XS2592804434	7.3750 % TEVA 7 3/8 09/15/29	100	0	0	100 EUR	112.00%	112'000.00	0.09	a)
XS2646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	400	300	0	700 EUR	109.02%	763'140.00	0.63	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	200	100	0	300 EUR	105.31%	315'933.00	0.26	a)
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	100	300	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	100	300	0	400 EUR	107.00%	428'008.00	0.35	a)
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	103.96%	103'962.00	0.09	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	100	300	0	400 EUR	102.60%	410'400.00	0.34	a)
XS2747181969	3.1250 % ABBNVX 3 1/8 01/15/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2764455619	3.8750 % KPN 3 7/8 02/16/36 GMTN	0	200	0	200 EUR	101.13%	202'252.00	0.17	a)
XS2774944008	6.8750 % ABNANV 6 7/8 PERP	0	400	0	400 EUR	103.16%	412'656.00	0.34	a)
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.64%	201'286.00	0.17	a)
XS2787827604	3.7500 % STLA 3 3/4 03/19/36 EMTN	0	400	200	200 EUR	99.11%	198'224.00	0.16	a)
XS2790191303	6.6250 % ASRND 6 5/8 PERP	0	200	0	200 EUR	99.97%	199'938.00	0.17	a)
XS2809859536	5.6250 % ACHMEA 5 5/8 11/02/44 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.71%	311'118.00	0.26	a)
XS2824778075	4.8750 % KPN 4 7/8 PERP	0	300	0	300 EUR	101.48%	304'437.00	0.25	a)
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	101.05%	202'094.00	0.17	a)
NL							8'782'239.68	7.25	
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	200	0	0	200 USD	91.59%	169'287.68	0.14	a)
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	200	0	0	200 USD	99.23%	183'410.23	0.15	a)
NO							352'697.91	0.29	
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	400	0	0	400 USD	102.33%	378'279.68	0.31	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBANK 5.398 11/29/27 REGS	400	300	0	700 USD	101.80%	658'560.91	0.54	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	0	700	0	700 USD	101.89%	659'117.24	0.54	a)
NZ							1'695'957.83	1.40	
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPL 5.943 04/23/2083 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTEDPZOM0011	4.7500 % EDPL 4 3/4 05/29/54 EMTN	0	500	0	500 EUR	100.26%	501'290.00	0.41	a)
PT							501'290.00	0.41	
XS2526881532	4.6250 % TELIAS 4 5/8 12/21/2082	300	0	0	300 EUR	100.86%	302'577.00	0.25	a)
SE							302'577.00	0.25	
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	200	300	0	500 USD	98.83%	456'677.32	0.38	a)
SG							456'677.32	0.38	
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	600	0	0	600 USD	69.90%	387'552.40	0.32	a)
US00206RMT67	5.4000 % T 5.4 02/15/34	300	0	0	300 USD	102.10%	283'061.02	0.23	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	100	400	0	500 USD	93.79%	433'384.63	0.36	a)
US00287YCB39	4.2500 % ABBV 4 1/4 11/21/49	600	0	0	600 USD	85.44%	473'768.18	0.39	a)
US009158BH84	4.6000 % APD 4.6 02/08/29	0	500	0	500 USD	100.72%	465'378.01	0.38	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	400	700	0	1'100 USD	76.06%	773'223.27	0.64	a)
US025816CW76	4.0500 % AXP 4.05 05/03/29	500	0	300	200 USD	98.33%	181'737.56	0.15	a)
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	475	0	475 USD	101.10%	443'772.77	0.37	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US03027XCH17	5.4500 % AMT 5.45 02/15/34	0	800	0	800 USD	102.01%	754'178.80	0.62	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	300	0	0	300 USD	97.75%	270'995.58	0.22	a)
US03040WBD65	5.1500 % AWK 5.15 03/01/34	0	400	0	400 USD	101.58%	375'481.41	0.31	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	300	0	0	300 USD	72.23%	200'252.50	0.17	a)
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	500	300	0	800 USD	101.65%	751'524.70	0.62	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	100	0	0	100 USD	100.77%	93'122.73	0.08	a)
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	300	0	0	300 USD	94.78%	262'764.35	0.22	a)
US036752AW30	5.5000 % ELV 5 1/2 10/15/32	100	0	0	100 USD	103.76%	95'890.50	0.08	a)
US036752AZ60	5.3750 % ELV 5 3/8 06/15/34	0	600	0	600 USD	102.56%	568'644.91	0.47	a)
US03740LAF94	5.0000 % AON 5 09/12/32	400	400	0	800 USD	99.75%	737'448.35	0.61	a)
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	200	0	0	200 USD	97.16%	179'580.64	0.15	a)
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	0	500	0	500 USD	102.08%	471'685.19	0.39	a)
US04636NAN30	5.0000 % AZN 5 02/26/34	0	500	0	500 USD	101.74%	470'123.41	0.39	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	200	0	0	200 USD	96.83%	178'959.62	0.15	a)
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	0	200	0	200 USD	91.10%	168'380.18	0.14	a)
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	500	500	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	500	1'000	500	1'000 USD	104.07%	961'705.13	0.79	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	300	0	0	300 USD	89.45%	247'979.20	0.20	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	200	200	0	400 USD	83.84%	309'901.45	0.26	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	400	0	0	400 USD	89.29%	330'073.36	0.27	a)
US110122EJ39	5.5000 % BMY 5 1/2 02/22/44	0	720	0	720 USD	101.63%	676'205.88	0.56	a)
US110122EK02	5.5500 % BMY 5.55 02/22/54	0	100	0	100 USD	101.28%	93'596.81	0.08	a)
US110122EL84	5.6500 % BMY 5.65 02/22/64	0	100	0	100 USD	100.65%	93'009.99	0.08	a)
US11135FBR10	4.0000 % AVGO 4 04/15/29 144A	100	0	0	100 USD	96.86%	89'514.93	0.07	a)
US11135FBV22	4.9260 % AVGO 4.926 05/15/37 144A	400	800	0	1'200 USD	96.47%	1'069'798.76	0.88	a)
US126408HV80	4.5000 % CSX 4 1/2 11/15/52	200	0	0	200 USD	87.98%	162'604.37	0.13	a)
US126408HW63	5.2000 % CSX 5.2 11/15/33	0	200	0	200 USD	102.53%	189'505.79	0.16	a)
US126650DS68	5.0000 % CVS 5 02/20/26	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	600	0	600 USD	99.72%	552'925.46	0.46	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	200	0	0	200 USD	95.22%	175'983.92	0.15	a)
US14448CBC73	5.9000 % CARR 5.9 03/15/34	0	400	0	400 USD	106.99%	395'486.98	0.33	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	300	400	0	700 USD	96.54%	624'482.70	0.52	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	50	0	0	50 USD	101.79%	47'032.67	0.04	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	200	0	100	100 USD	103.21%	95'374.84	0.08	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967PG03	5.8270 % C 5.827 02/13/35	0	400	0	400 USD	101.10%	373'732.96	0.31	a)
US172967PL97	5.4490 % C 5.449 06/11/35	0	1'000	0	1'000 USD	101.64%	939'294.97	0.78	a)
US17327CAN39	2.0140 % C 2.014 01/25/26	400	400	500	300 USD	98.30%	272'534.25	0.23	a)
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	250	0	0	250 USD	57.93%	133'839.44	0.11	a)
US20030NEC11	4.6500 % CMCSA 4.65 02/15/33	700	0	0	700 USD	98.66%	638'209.72	0.53	a)
US22822VBA89	5.0000 % CCI 5 01/11/28	400	0	0	400 USD	100.26%	370'602.01	0.31	a)
US22822VBE02	5.8000 % CCI 5.8 03/01/34	0	300	0	300 USD	103.97%	288'253.71	0.24	a)
US237266AJ06	6.0000 % DAR 6 06/15/30 144A	200	0	0	200 USD	99.23%	183'399.14	0.15	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	100	0	0	100 USD	101.84%	94'114.32	0.08	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	400	0	0	400 USD	104.67%	386'925.84	0.32	a)
US24703DBN03	5.4000 % DELL 5.4 04/15/34	0	600	0	600 USD	101.08%	560'460.82	0.46	a)
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	400	300	300	400 USD	99.86%	369'123.40	0.30	a)
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	300	0	0	300 USD	93.20%	258'378.43	0.21	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	100	0	0	100 USD	94.60%	87'419.93	0.07	a)
US337738BH05	5.6250 % FI 5 5/8 08/21/33	200	0	0	200 USD	103.57%	191'422.44	0.16	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	400	300	0	700 USD	84.02%	543'511.35	0.45	a)
US36267VAF04	5.6500 % GEHC 5.65 11/15/27	0	400	0	400 USD	102.56%	379'126.18	0.31	a)
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	400	0	0	400 USD	111.15%	410'864.50	0.34	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	500	300	0	800 USD	101.38%	749'506.40	0.62	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	300	600	0	900 USD	94.41%	785'257.29	0.65	a)
US38145GAH39	3.5000 % GS 3 1/2 11/16/26	500	0	0	500 USD	97.12%	448'776.01	0.37	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	200	0	0	200 USD	95.28%	176'098.52	0.15	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	150	0	0	150 USD	94.56%	131'073.05	0.11	a)
US42824CBP32	5.2500 % HPE 5 1/4 07/01/28	400	200	0	600 USD	102.11%	566'183.03	0.47	a)
US437076AS19	5.8750 % HD 5 7/8 12/16/36	300	0	0	300 USD	108.70%	301'358.79	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US458140CF51	5.1250 % INTC 5 1/8 02/10/30	400	0	300	100 USD	102.32%	94'558.83	0.08	a)
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	400	0	0	400 USD	100.16%	370'247.14	0.31	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	100	0	0	100 USD	96.14%	88'848.63	0.07	a)
US46647PCM68	0.7680 % JPM 0.768 08/09/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	400	500	200	700 USD	101.83%	658'722.64	0.54	a)
US46647PDW32	6.0700 % JPM 6.07 10/22/27	400	400	300	500 USD	102.59%	474'027.86	0.39	a)
US46647PEC68	5.3360 % JPM 5.336 01/23/35	400	400	0	800 USD	101.66%	751'576.45	0.62	a)
US478160CE22	2.9500 % JNJ 2.95 03/03/27	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836CA47	5.7500 % K 5 3/4 05/16/54	0	700	0	700 USD	101.47%	656'413.24	0.54	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	500	400	0	900 USD	89.27%	742'432.18	0.61	a)
US532457CL03	4.7000 % LLY 4.7 02/09/34	0	500	0	500 USD	100.22%	463'086.16	0.38	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	100	300	0	400 USD	99.09%	366'277.08	0.30	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	300	0	0	300 USD	101.51%	281'419.76	0.23	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	500	400	0	900 USD	101.38%	843'161.43	0.70	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	200	0	0	200 USD	78.52%	145'132.77	0.12	a)
US57636QAZ72	4.8750 % MA 4 7/8 05/09/34	0	700	0	700 USD	101.38%	655'818.10	0.54	a)
US58933YBL83	4.9000 % MRK 4.9 05/17/44	0	500	0	500 USD	96.17%	444'354.05	0.37	a)
US59156RBN70	4.0500 % MET 4.05 03/01/45	600	400	0	1'000 USD	82.82%	765'336.74	0.63	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	0	600	0	600 USD	70.15%	388'966.32	0.32	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	300	0	0	300 USD	84.90%	235'370.37	0.19	a)
US595112CB74	5.8750 % MU 5 7/8 09/15/33	300	0	0	300 USD	104.30%	289'154.73	0.24	a)
US595112CD31	5.3000 % MU 5.3 01/15/31	0	300	0	300 USD	101.66%	281'852.26	0.23	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	700	0	0	700 USD	101.49%	656'536.14	0.54	a)
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	200	300	0	500 USD	97.54%	450'688.96	0.37	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	400	0	400 USD	102.48%	378'815.67	0.31	a)
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	600	0	0	600 USD	103.99%	576'612.76	0.48	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	250	0	0	250 USD	100.72%	232'686.69	0.19	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	400	300	0	700 USD	100.92%	652'816.52	0.54	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	400	0	300	100 USD	95.78%	88'510.40	0.07	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	400	0	0	400 USD	87.74%	324'317.88	0.27	a)
US744320BP63	6.5000 % PRU 6 1/2 03/15/54	0	300	0	300 USD	102.00%	282'786.55	0.23	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	200	400	0	600 USD	88.50%	490'701.94	0.41	a)
US747525BT99	6.0000 % QCOM 6 05/20/53	300	0	0	300 USD	110.15%	305'375.99	0.25	a)
US75884RBA05	3.7000 % REG 3.7 06/15/30	300	0	0	300 USD	94.02%	260'671.20	0.22	a)
US75884RBB87	5.2500 % REG 5 1/4 01/15/34	0	400	0	400 USD	100.20%	370'406.09	0.31	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	400	300	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US828807DW40	6.2500 % SPG 6 1/4 01/15/34	0	200	0	200 USD	107.94%	199'508.58	0.16	a)
US828807DX23	6.6500 % SPG 6.65 01/15/54	300	0	0	300 USD	113.38%	314'322.49	0.26	a)
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	400	0	0	400 USD	104.67%	386'922.14	0.32	a)
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	0	300	0	300 USD	110.88%	307'408.15	0.25	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	400	400	0	800 USD	100.79%	745'122.32	0.62	a)
US87264ACV52	5.2000 % TMUS 5.2 01/15/33	100	0	0	100 USD	101.12%	93'448.03	0.08	a)
US87264ACW36	5.6500 % TMUS 5.65 01/15/53	700	500	0	1'200 USD	100.79%	1'117'705.66	0.92	a)
US883556CY62	5.4040 % TMO 5.404 08/10/43	200	0	0	200 USD	102.08%	188'666.68	0.16	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	150	0	0	150 USD	83.41%	115'621.14	0.10	a)
US907818GC65	4.9500 % UNP 4.95 09/09/52	300	200	0	500 USD	95.82%	442'755.30	0.37	a)
US91324PEU21	4.2500 % UNH 4 1/4 01/15/29	650	300	0	950 USD	99.00%	869'161.82	0.72	a)
US91324PFC14	5.3750 % UNH 5 3/8 04/15/54	0	600	0	600 USD	99.03%	549'088.47	0.45	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	600	800	0	1'400 USD	71.91%	930'345.70	0.77	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	550	0	0	550 USD	69.94%	355'485.09	0.29	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	200	0	0	200 USD	97.20%	179'656.42	0.15	a)
US928563AL97	2.2000 % VMW 2.2 08/15/31	300	0	0	300 USD	83.54%	231'608.23	0.19	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	100	500	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBR96	2.9500 % WM 2.95 06/01/41	0	500	0	500 USD	74.57%	344'557.25	0.28	a)
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	300	0	0	300 USD	96.46%	267'435.83	0.22	a)
US95040QAF19	4.9500 % WELL 4.95 09/01/48	300	0	0	300 USD	93.15%	258'239.81	0.21	a)
US95040QAK04	2.7000 % WELL 2.7 02/15/27	0	200	0	200 USD	95.34%	176'214.96	0.15	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	400	300	0	700 USD	102.29%	661'698.33	0.55	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	300	400	0	700 USD	102.45%	662'752.77	0.55	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	500	0	0	500 USD	106.23%	490'847.03	0.41	a)
X52343510520	0.5000 % K 0 1/2 05/20/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	300	200	0	500 EUR	83.87%	419'330.00	0.35	a)
XS2386186576	1.1250 % LLY 1 1/8 09/14/51	100	0	0	100 EUR	62.39%	62'391.00	0.05	a)
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	200	0	0	200 EUR	83.63%	167'256.00	0.14	a)
XS2484340075	2.7500 % PPG 2 3/4 06/01/29	150	200	0	350 EUR	97.73%	342'069.00	0.28	a)
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	100	0	0	100 EUR	104.55%	104'546.00	0.09	a)
XS2790333707	3.7900 % MS 3.79 03/21/30	0	500	0	500 EUR	101.46%	507'320.00	0.42	a)
US							50'334'727.18	41.57	
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	500	0	0	500 USD	99.33%	458'959.92	0.38	a)
XS							458'959.92	0.38	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

JPY/EUR	Verfall 04.03.2024	221'207	35'000'000		EUR/JPY	0.00	0.00
CAD/EUR	Verfall 04.03.2024	1'340'438	1'947'000		EUR/CAD	0.00	0.00
GBP/EUR	Verfall 04.03.2024	1'622'029	1'385'000		EUR/GBP	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 04.03.2024	26'337'372	28'645'000		EUR/USD	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.03.2024	452'703	421'000		EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 04.03.2024	264'000	245'487		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 04.03.2024	11'000	7'572		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 04.03.2024	260'000	242'362		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024	59'000	62'240		CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 04.03.2024	1'385'000	1'619'012		GBP/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024	362'000	379'873		CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 04.03.2024	28'121'000	25'987'432		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 04.03.2024	1'936'000	1'319'089		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/JPY	Verfall 04.03.2024	35'000'000	216'085		JPY/EUR	0.00	0.00
AUD/EUR	Verfall 03.04.2024	255'645	425'000		EUR/AUD	0.00	0.00
GBP/EUR	Verfall 03.04.2024	1'479'525	1'267'000		EUR/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024	425'850	405'000		EUR/CHF	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 03.04.2024	25'877'052	28'036'000		EUR/USD	0.00	0.00
CAD/EUR	Verfall 03.04.2024	1'190'043	1'748'000		EUR/CAD	0.00	0.00
JPY/EUR	Verfall 03.04.2024	226'468	36'554'000		EUR/JPY	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.04.2024	90'000	82'286		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	44'000	45'080		CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.04.2024	9'000	10'504		GBP/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.04.2024	17'000	11'562		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	361'000	371'113		CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.04.2024	27'946'000	25'877'124		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.04.2024	1'731'000	1'184'456		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/AUD	Verfall 03.04.2024	425'000	256'715		AUD/EUR	0.00	0.00
EUR/JPY	Verfall 03.04.2024	36'554'000	223'625		JPY/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.04.2024	1'258'000	1'471'500		GBP/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024	1'600'421	1'411'000		CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.05.2024	1'290'200	1'944'000		CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 03.05.2024	320'053	546'000		CHF/AUD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.05.2024	28'170'548	31'380'000		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024	10'376'058	10'689'000		CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024	371'900	361'000		EUR/CHF	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 03.05.2024	25'746'885	27'839'000		EUR/USD	0.00	0.00
CAD/EUR	Verfall 03.05.2024	1'179'432	1'725'000		EUR/CAD	0.00	0.00
AUD/EUR	Verfall 03.05.2024	292'248	484'000		EUR/AUD	0.00	0.00
GBP/EUR	Verfall 03.05.2024	1'462'948	1'252'000		EUR/GBP	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.05.2024	191'000	176'297		USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.05.2024	13'000	8'892		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.05.2024	8'000	9'319		GBP/EUR	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 03.05.2024	181'000	164'622		USD/CHF	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.05.2024	10'000	6'807		CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.05.2024	190'000	177'359		USD/EUR	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 03.05.2024	10'000	6'632		CAD/CHF	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.05.2024	18'000	21'045		GBP/EUR	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 03.05.2024	14'000	9'255		CAD/CHF	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.05.2024	13'000	8'886		CAD/EUR	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 03.05.2024	18'000	20'353		GBP/CHF	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.05.2024	180'000	169'213		USD/EUR	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 03.05.2024	190'000	173'157		USD/CHF	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.05.2024	10'000	11'701		GBP/EUR	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 03.05.2024	11'000	12'486		GBP/CHF	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.05.2024	192'000	179'879		USD/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	EUR/AUD Verfall 03.05.2024		3'000	1'806	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		3'000	3'072	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		290'224	254'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		69'275	116'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		1'845'604	1'892'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		218'126	327'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 03.05.2024		18'000	12'309	CAD/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		4'925'133	5'409'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		36'418'000	33'402'590	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.05.2024		27'086'000	25'332'959	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2024		63'656'000	371'019	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		12'581'000	12'338'816	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 03.05.2024		1'671'000	1'137'454	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2024		2'247'000	1'500'052	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 03.05.2024		47'319'000	281'220	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		358'000	365'027	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 03.05.2024		481'000	292'094	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2024		662'000	394'274	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 03.05.2024		1'216'000	1'423'988	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		1'636'000	1'878'881	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		322'725	54'151'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 07.05.2024		295'018	48'041'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 07.05.2024		250'000	1'541	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 07.05.2024		472'000	2'814	JPY/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		55'252	9'505'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		33'061'509	36'177'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.06.2024		25'183'828	26'961'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		370'196	63'448'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		12'156'350	12'424'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.06.2024		1'139'267	1'675'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		1'495'379	2'247'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 04.06.2024		281'895	47'285'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		422'083	413'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 04.06.2024		298'076	491'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		392'042	660'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.06.2024		1'424'740	1'218'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		1'871'290	1'635'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		155'000	158'518	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		66'000	64'546	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		261'000	243'918	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		8'000	9'098	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		10'000	6'820	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		6'000	7'002	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		339'000	308'691	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		12'000	7'974	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		6'000	3'687	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		7'000	4'189	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		412'000	2'482	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		4'000	2'446	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		624'000	3'741	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		221'000	205'376	USD/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		1'716'542	1'901'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		53'066	80'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		25'936	43'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		16'424	2'819'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		16'000	18'638	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		455'740	464'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		31'000	20'939	CAD/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		76'648	67'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		14'000	16'439	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		26'479'000	24'389'997	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		66'267'000	380'412	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		258'000	263'427	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		46'249'000	271'088	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		1'634'000	1'104'256	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		696'000	417'558	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		12'822'000	12'556'585	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		1'182'000	1'386'331	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		1'694'000	1'945'830	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		481'000	294'653	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		37'739'000	34'044'352	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		2'315'000	1'532'021	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.07.2024		24'403'999	26'527'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		386'150	67'195'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		330'437	323'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
JPY/EUR	Verfall 02.07.2024		275'013	46'777'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.07.2024		421'943	705'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/EUR	Verfall 02.07.2024		1'378'955	1'177'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		12'711'518	13'006'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.07.2024		1'937'594	1'692'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/EUR	Verfall 02.07.2024		300'649	491'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		34'263'825	38'105'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		215'433	241'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.07.2024		120'327	131'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		200'840	226'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.07.2024		142'394	155'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/GBP	Verfall 02.07.2024		1'177'000	1'388'283	GBP/EUR		0.00	0.00	
EUR/CAD	Verfall 02.07.2024		1'620'000	1'104'676	CAD/EUR		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.07.2024		705'000	423'071	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.07.2024		38'572'000	34'659'256	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		323'000	335'375	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/AUD	Verfall 02.07.2024		491'000	305'972	AUD/EUR		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 02.07.2024		26'813'000	25'019'128	USD/EUR		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.07.2024		2'328'000	1'528'607	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.07.2024		1'692'000	1'921'926	GBP/CHF		0.00	0.00	
EUR/JPY	Verfall 02.07.2024		46'777'000	271'339	JPY/EUR		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.07.2024		13'006'000	12'524'778	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.07.2024		67'195'000	375'345	JPY/CHF		0.00	0.00	
CAD/EUR	Verfall 03.07.2024		1'094'020	1'620'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.07.2024		1'536'568	2'328'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/EUR	Verfall 05.08.2024		1'359'259	1'154'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.08.2024		35'137'494	39'266'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.08.2024		398'667	383'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.08.2024		24'574'815	26'379'000	EUR/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.08.2024		1'943'871	1'718'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/EUR	Verfall 05.08.2024		264'266	45'396'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		12'863'033	13'391'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.08.2024		377'853	67'573'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		23'000	23'956	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.08.2024		1'718'000	1'942'354	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.08.2024		67'573'000	395'309	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.08.2024		13'391'000	12'754'928	EUR/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		360'000	377'913	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.08.2024		39'266'000	34'562'326	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/GBP	Verfall 05.08.2024		1'154'000	1'369'605	GBP/EUR		0.00	0.00	
EUR/JPY	Verfall 05.08.2024		45'396'000	278'910	JPY/EUR		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 05.08.2024		26'379'000	24'376'473	USD/EUR		0.00	0.00	
CAD/EUR	Verfall 06.08.2024		1'089'435	1'599'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.08.2024		427'654	715'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
AUD/EUR	Verfall 06.08.2024		298'902	480'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 06.08.2024		1'557'524	2'380'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.08.2024		715'000	410'961	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.08.2024		2'380'000	1'516'441	CAD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CAD	Verfall 06.08.2024		1'599'000	1'069'518	CAD/EUR		0.00	0.00	
EUR/AUD	Verfall 06.08.2024		480'000	289'616	AUD/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.09.2024		1'984'404	1'761'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 04.09.2024		399'121	68'166'000	CHF/JPY		0.00	0.00	b)
USD/EUR	Verfall 04.09.2024		24'505'105	26'559'000	EUR/USD		0.00	0.00	b)
JPY/EUR	Verfall 04.09.2024		278'721	45'227'000	EUR/JPY		0.00	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 04.09.2024		417'303	728'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 04.09.2024		13'118'578	13'803'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 04.09.2024		416'610	396'000	EUR/CHF		0.00	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 04.09.2024		1'556'872	2'450'000	CHF/CAD		0.00	0.00	b)
GBP/EUR	Verfall 04.09.2024		1'384'679	1'168'000	EUR/GBP		0.00	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 04.09.2024		35'108'231	40'030'000	CHF/USD		0.00	0.00	b)
AUD/EUR	Verfall 04.09.2024		291'254	483'000	EUR/AUD		0.00	0.00	b)
CAD/EUR	Verfall 04.09.2024		1'086'303	1'625'000	EUR/CAD		0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert EUR	in % 7)
Bauguthaben auf Sicht	3'269'244.96	2.70
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	116'270'263.72	96.02
Sonstige Vermögenswerte	1'546'346.35	1.28
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	121'085'855.03	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-30'537.24	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	121'055'317.79	

Bewertungskategorien		Kurswert EUR	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);	116'270'263.72	96.02
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = EUR	0.60345689
CAD	1 = EUR	0.66895653
CHF	1 = EUR	1.04984947
GBP	1 = EUR	1.18699878
JPY	100 = EUR	0.61420300
USD	1 = EUR	0.92413000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	55'205'819.94	45.604
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	69'582'599.76	57.480

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AAH1 EUR	EUR	-	-	-	-
BAH1 EUR	EUR	-	-	-	-
CTH1 EUR	EUR	-	-	-	-
DAH1 EUR	EUR	-	-	-	-
GTH1 EUR	EUR	-	-	-	-
NT CHF	EUR	-	-	-	-
NTH1 CHF	EUR	-	-	-	-

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Andere Wertpapiere	EUR	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max			Eff	Max
AAH1 EUR	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000	4.000
BAH1 EUR	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000	4.000
CTH1 EUR	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000	4.000
DAH1 EUR	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000	4.000
GTH1 EUR	0.430	0.600	0.330	0.100	4.000	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000	4.000

Periode: 28.03.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max			Eff	Max
NTH1 CHF	-	-	-	-	4.000	4.000

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

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.
- 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.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

11 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 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 0.0001 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, marktconforme 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) 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 zu-zurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden 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 Anteils-klassen 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 Kapital-erträgen 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.