

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE HEDGED CHF

## Halbjahresbericht per 31.07.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	70090	CHF
BA CHF	20594694	CHF
CT CHF	37864032	CHF
DA CHF	2561682	CHF
DT CHF	35656961	CHF
GT CHF	19224150	CHF
MT CHF	51788926	CHF
NT CHF	19224149	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	18
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	18
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	19
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
8	Pauschale Verwaltungskommission	20
9	Benchmark	20
10	TER	20
11	Fussnoten	21
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	22

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.07.2023	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
<b>Konsolidiert</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'696'391'156.66	1'753'830'780.01	1'943'684'018.26	1'691'623'929.10
<b>Klasse AA CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		205'266'251.92	231'948'271.41	304'496'219.92	376'761'290.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'539'345.968	2'745'263.380	3'120'838.572	3'611'544.274
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		80.8343	84.4904	97.5687	104.3200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		80.6969	84.6509	97.4224	104.5000
Ausschüttung je Anteil		-	1.85	1.80	2.00
Total Expense Ratio (TER)					1.05 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	
<b>Klasse BA CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		16'255'541.91	20'662'831.91	25'048'683.12	26'792'591.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		211'857.509	257'044.488	270'023.269	269'865.018
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		76.7287	80.3862	92.7649	99.2800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		76.5982	80.5389	92.6258	99.4500
Ausschüttung je Anteil		-	2.10	2.00	2.40
Total Expense Ratio (TER)					0.63 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	
<b>Klasse CT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		58'178'206.28	62'455'732.59	78'488'613.26	85'511'804.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		670'550.333	699'815.137	774'156.515	801'399.348
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		86.7619	89.2460	101.3860	106.7000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		86.6144	89.4156	101.2339	106.8800
Thesaurierung je Anteil		-	2.25	2.37	2.61
Total Expense Ratio (TER)					0.57 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	
<b>Klasse DA CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		66'320'720.84	75'248'041.30	75'406'133.91	75'622'601.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		799'402.154	864'971.866	750'128.820	702'479.390
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		82.9629	86.9948	100.5242	107.6500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		82.8219	87.1601	100.3735	107.8300
Ausschüttung je Anteil		-	2.40	2.40	2.80
Total Expense Ratio (TER)					0.50 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	
<b>Klasse DT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		42'248'795.59	46'945'573.61	71'139'696.12	66'650'424.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		480'460.131	519'061.794	692'675.145	616'911.371
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		87.9340	90.4431	102.7028	108.0400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		87.7845	90.6150	102.5488	108.2200
Thesaurierung je Anteil		-	2.34	2.47	2.72
Total Expense Ratio (TER)					0.50 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	

<b>Klasse GT CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	106'920'598.63	112'913'905.06	123'177'562.79	157'972'286.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'110'935.320	1'140'815.765	1'096'612.402	1'337'804.439
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode (1) 23)	96.2438	98.9765	112.3255	118.0800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)	96.0802	99.1645	112.1570	118.2800
Thesaurierung je Anteil	-	2.66	2.82	3.08
Total Expense Ratio (TER)				0.40 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.40 %	0.40 %	0.40 %	

---

<b>Klasse MT CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	7'293'041.48	7'495'994.33	8'774'359.16	6'054'078.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	84'932.517	84'932.517	87'812.517	57'789.558
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode (1) 23)	85.8687	88.2582	99.9215	104.7600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)	85.7227	88.4259	99.7716	104.9400
Thesaurierung je Anteil	-	2.72	2.92	3.13
Total Expense Ratio (TER)				0.00 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	

---

<b>Klasse NT CHF</b>	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'193'908'000.01	1'196'160'429.80	1'257'152'749.98	896'258'852.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	12'076'131.645	11'771'338.273	10'927'496.357	7'430'353.528
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode (1) 23)	98.8651	101.6164	115.0449	120.6200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)	98.6970	101.8094	114.8723	120.8300
Thesaurierung je Anteil	-	3.14	3.36	3.61
Total Expense Ratio (TER)				0.00 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	

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

## Performance

	<b>YTD / 31.07.2023</b>	<b>2022</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>
Klasse AA CHF	0.66 %	-16.78 %	-2.70 %	6.15 %
Klasse BA CHF	0.91 %	-16.43 %	-2.29 %	6.58 %
Klasse CT CHF	0.94 %	-16.38 %	-2.24 %	6.66 %
Klasse DA CHF	1.37 %	-16.51 %	-2.17 %	6.72 %
Klasse DT CHF	1.37 %	-16.51 %	-2.16 %	6.73 %
Klasse GT CHF	1.43 %	-16.42 %	-2.07 %	6.84 %
Klasse MT CHF (Lancierung 27.01.2020)	1.27 %	-15.90 %	-1.68 %	5.84 %
Klasse NT CHF	1.67 %	-16.09 %	-1.68 %	7.26 %

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	18'415'284.11	32'164'530.75
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'555'613'152.71	1'610'408'336.51
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	88'217'555.22	87'685'521.39
Derivative Finanzinstrumente	16'094'327.97	6'853'671.70
Sonstige Vermögenswerte	18'354'621.89	17'658'921.30
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'696'694'941.90</b>	<b>1'754'770'981.65</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-592'026.34
Andere Verbindlichkeiten	-303'785.24	-348'175.30
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'696'391'156.66</b>	<b>1'753'830'780.01</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'745'263.380	3'120'838.572
Ausgegebene Anteile		62'436.506	97'414.601
Zurückgenommene Anteile		-268'353.918	-472'989.793
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'539'345.968</b>	<b>2'745'263.380</b>
<b>Klasse BA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		257'044.488	270'023.269
Ausgegebene Anteile		15'917.444	18'077.933
Zurückgenommene Anteile		-61'104.423	-31'056.714
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>211'857.509</b>	<b>257'044.488</b>
<b>Klasse CT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		699'815.137	774'156.515
Ausgegebene Anteile		17'620.956	21'478.144
Zurückgenommene Anteile		-46'885.760	-95'819.522
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>670'550.333</b>	<b>699'815.137</b>
<b>Klasse DA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		864'971.866	750'128.820
Ausgegebene Anteile		34'621.084	176'212.420
Zurückgenommene Anteile		-100'190.796	-61'369.374
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>799'402.154</b>	<b>864'971.866</b>
<b>Klasse DT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		519'061.794	692'675.145
Ausgegebene Anteile		17'507.577	67'709.455
Zurückgenommene Anteile		-56'109.240	-241'322.806
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>480'460.131</b>	<b>519'061.794</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'140'815.765	1'096'612.402
Ausgegebene Anteile		134'552.850	165'952.123
Zurückgenommene Anteile		-164'433.295	-121'748.760
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'110'935.320</b>	<b>1'140'815.765</b>
<b>Klasse MT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		84'932.517	87'812.517
Zurückgenommene Anteile		-	-2'880.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>84'932.517</b>	<b>84'932.517</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'771'338.273	10'927'496.357
Ausgegebene Anteile		579'552.729	1'377'180.102
Zurückgenommene Anteile		-274'759.357	-533'338.186
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>12'076'131.645</b>	<b>11'771'338.273</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2023 31.07.2023</b>	<b>01.02.2022 31.01.2023</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'753'830'780.01	1'943'684'018.26
Ausbezahlte Ausschüttung		-7'416'429.81	-7'649'436.98
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-15'404'195.70	-15'577'774.84
Saldo aus dem Anteilverkehr		-3'098'358.92	46'487'685.97
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-31'520'638.92	-213'113'712.40
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'696'391'156.66</b>	<b>1'753'830'780.01</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2023 31.07.2023</b>	<b>01.02.2022 31.01.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		271'636.47	6'223.50
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-850.24	-78'404.82
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		26'055'538.31	52'246'412.95
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		0.00	1'214'908.80
Erträge aus Wertpapierleihe		212'841.45	365'909.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		448'822.78	2'499'209.81
<b>Total Ertrag</b>		<b>26'987'988.77</b>	<b>56'254'259.59</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-430.97
Reglementarische Vergütungen		-1'875'772.02	-4'168'395.93
Sonstige Aufwendungen		-252.00	-414.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-711'382.92	-1'849'287.52
<b>Total Aufwand</b>		<b>-2'587'406.94</b>	<b>-6'018'528.43</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>24'400'581.83</b>	<b>50'235'731.16</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		25'739'916.10	-58'416'538.72
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		229'999.72	527'143.04
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>50'370'497.65</b>	<b>-7'653'664.52</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-81'891'136.57	-205'460'047.88
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-31'520'638.92</b>	<b>-213'113'712.40</b>



## 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'555'613'152.71</b>	<b>91.68</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'555'613'152.71</b>	<b>91.68</b>	
AU3CB0243764	4.0000 % TLSAU 4 04/19/27 MTN	11'000	0	0	11'000 AUD	97.22%	6'246'641.07	0.37	a)
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	5'550	0	0	5'550 AUD	98.30%	3'186'791.76	0.19	a)
<b>AUD</b>							<b>9'433'432.83</b>	<b>0.56</b>	
CA00206RDY59	4.8500 % T 4.85 05/25/47 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	86.40%	1'137'965.78	0.07	a)
CA0641515959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	10'000	0	0	10'000 CAD	92.74%	6'107'760.90	0.36	a)
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	3'000	0	0	3'000 CAD	72.90%	1'440'265.10	0.08	a)
CA07813ZCE21	2.5000 % BCECN 2 1/2 05/14/30 MTN	4'000	0	0	4'000 CAD	84.59%	2'228'356.06	0.13	a)
CA29251ZBU09	3.1000 % ENBCN 3.1 09/21/33 MTN	10'000	0	0	10'000 CAD	82.09%	5'406'114.56	0.32	a)
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	3'000	0	0	3'000 CAD	87.38%	1'726'449.09	0.10	a)
CA780086RA47	2.7400 % RY 2.74 07/25/29	11'000	0	0	11'000 CAD	96.83%	7'014'685.22	0.41	a)
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	8'000	0	0	8'000 CAD	90.38%	4'761'975.04	0.28	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	13'000	0	0	13'000 CAD	91.31%	7'817'745.60	0.46	a)
<b>CAD</b>							<b>37'641'317.35</b>	<b>2.22</b>	
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP	5'000	0	0	5'000 CHF	98.05%	4'902'500.00	0.29	a)
<b>CHF</b>							<b>4'902'500.00</b>	<b>0.29</b>	
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	1'900	0	0	1'900 EUR	89.38%	1'623'135.74	0.10	a)
AT0000A2L583	4.2500 % ERSTBK 4 1/4 PERP PERP	8'000	0	0	8'000 EUR	79.21%	6'056'356.80	0.36	a)
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	100.17%	4'786'985.78	0.28	a)
BE6317598850	3.8750 % AGSBB 3 7/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	74.38%	1'563'940.79	0.09	a)
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	4'100	0	1'100	3'000 EUR	73.78%	2'115'328.46	0.12	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	2'700	0	2'700 EUR	99.25%	2'561'257.45	0.15	a)
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	83.08%	4'764'420.67	0.28	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	6'000	0	0	6'000 EUR	95.37%	5'468'842.03	0.32	a)
CH1214797172	7.7500 % UBS 7 3/4 03/01/29	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	83.05%	3'968'773.58	0.23	a)
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	8'000	0	0	8'000 EUR	71.78%	5'488'109.82	0.32	a)
DE000A25BDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	102.37%	1'956'827.92	0.12	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	4'900	0	0	4'900 EUR	98.07%	4'592'572.22	0.27	a)
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3.7 05/30/31 EMTN	0	4'800	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	6'300	0	0	6'300 EUR	94.96%	5'717'777.90	0.34	a)
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	100.28%	2'396'121.19	0.14	a)
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	76.41%	2'921'211.57	0.17	a)
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'400	0	0	1'400 EUR	85.30%	1'141'375.91	0.07	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	90.28%	2'588'450.27	0.15	a)
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	90.44%	3'457'613.17	0.20	a)
DE000LB2CPE5	4.0000 % LBBW 4 PERP EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	8'000	0	0	8'000 EUR	99.17%	7'582'411.92	0.45	a)
FR0013331949	3.1250 % FRPTT 3 1/8 PERP	2'500	0	0	2'500 EUR	93.40%	2'231'542.12	0.13	a)
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	6'100	0	0	6'100 EUR	80.85%	4'713'584.67	0.28	a)
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	87.81%	1'678'381.55	0.10	a)
FR00140046Y4	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 PERP	3'100	0	0	3'100 EUR	76.73%	2'273'331.06	0.13	a)
FR0014006NI7	0.5000 % BNP 0 1/2 05/30/28 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	4'600	0	0	4'600 EUR	84.79%	3'727'681.50	0.22	a)
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	4'400	0	2'000	2'400 EUR	100.61%	2'307'731.14	0.14	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	6'800	0	2'800	4'000 EUR	102.42%	3'915'376.18	0.23	a)
FR001400F1G3	3.6250 % ENGIFP 3 5/8 01/11/30 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 EUR	99.48%	2'852'321.56	0.17	a)
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	98.29%	4'133'446.32	0.24	a)
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	99.75%	2'002'024.09	0.12	a)
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPLP 5.943 04/23/2083 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	99.78%	2'384'126.60	0.14	a)
XS1048529041	2.5000 % RDSALN 2 1/2 03/24/26 EMTN	3'115	0	3'115	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	97.71%	5'603'257.82	0.33	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.
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	94.81%	6'342'783.64	0.37	a)
XS1640667116	8.6590 % RBAV 8.659 PERP	2'600	0	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1640903701	4.7500 % HSBC 4 3/4 PERP EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	86.39%	4'954'116.69	0.29	a)
XS1693822634	4.7500 % ABNAV 4 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	87.08%	3'328'893.61	0.20	a)
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	84.66%	3'236'415.84	0.19	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	5'000	0	0	5'000 EUR	88.22%	4'215'689.97	0.25	a)
XS1785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1793250041	4.7500 % SANTAN 4 3/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	87.34%	4'173'828.40	0.25	a)
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877860533	4.6250 % RABOBK 4 5/8 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	92.78%	5'320'606.17	0.31	a)
XS2010028343	2.8750 % SESGFP 2 7/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	85.85%	3'282'023.93	0.19	a)
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	4'000	0	2'000	2'000 EUR	80.34%	1'535'669.89	0.09	a)
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	2'000	0	0	2'000 EUR	88.58%	1'693'195.57	0.10	a)
XS2022424993	1.7500 % ISPIM 1 3/4 07/04/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	87.15%	3'331'875.53	0.20	a)
XS2050933972	3.2500 % RABOBK 3 1/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	85.01%	4'062'293.11	0.24	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	8'000	0	0	8'000 EUR	79.47%	6'075'930.44	0.36	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	80.43%	3'843'714.52	0.23	a)
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	3'800	0	0	3'800 EUR	82.15%	2'983'363.58	0.18	a)
XS2102912966	4.3750 % SANTAN 4 3/8 PERP	1'000	0	0	1'000 EUR	86.12%	823'038.70	0.05	a)
XS2109819859	2.5020 % TELEFO 2.502 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	87.56%	2'510'490.26	0.15	a)
XS2182055009	3.7500 % FIRMEN 3 3/4 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	96.11%	2'020'738.50	0.12	a)
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	91.46%	3'496'378.14	0.21	a)
XS2189784288	6.1250 % CMZB 6 1/8 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	92.87%	4'437'995.96	0.26	a)
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	0	3'000	0	3'000 EUR	88.82%	2'546'560.03	0.15	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	6'000	0	0	6'000 EUR	80.84%	4'635'854.03	0.27	a)
XS2201857534	2.4290 % ASSGEN 2.429 07/14/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	82.77%	3'164'391.00	0.19	a)
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	89.54%	4'278'960.21	0.25	a)
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	93.72%	1'791'484.26	0.11	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	4'000	0	0	4'000 EUR	89.98%	3'439'836.34	0.20	a)
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	4'800	0	0	4'800 EUR	77.34%	3'548'210.03	0.21	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	91.49%	2'623'201.12	0.15	a)
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	4'300	1'700	0	6'000 EUR	78.39%	4'495'302.36	0.26	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	78.07%	3'730'506.68	0.22	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	2'800	0	0	2'800 EUR	74.63%	1'997'133.55	0.12	a)
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	7'600	0	0	7'600 EUR	82.17%	5'968'760.98	0.35	a)
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	4'300	0	0	4'300 EUR	43.15%	1'773'129.20	0.10	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	69.93%	1'871'491.48	0.11	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	6'000	0	0	6'000 EUR	84.24%	4'830'940.44	0.28	a)
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	77.21%	3'689'553.06	0.22	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	3'900	0	0	3'900 EUR	85.99%	3'205'303.52	0.19	a)
XS2342732562	3.7480 % VW 3.748 PERP	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	85.40%	1'387'516.24	0.08	a)
XS2353073161	2.6250 % POSIM 2 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	77.46%	1'480'695.52	0.09	a)
XS2353473692	1.3750 % RBAV 1 3/8 06/17/33	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	80.09%	3'827'275.73	0.23	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	3'500	0	0	3'500 EUR	84.35%	2'821'460.59	0.17	a)
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	85.20%	3'582'850.00	0.21	a)
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	7'000	0	0	7'000 EUR	81.32%	5'440'408.65	0.32	a)
XS2381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	8'000	0	0	8'000 EUR	73.18%	5'595'306.03	0.33	a)
XS2386220698	1.3750 % LLY 1 3/8 09/14/61	5'000	0	0	5'000 EUR	51.52%	2'461'804.67	0.15	a)
XS2388141892	1.0000 % ADENX 1 03/21/2082	4'400	0	1'000	3'400 EUR	79.47%	2'582'400.42	0.15	a)
XS2388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	68.77%	1'314'434.34	0.08	a)
XS2388876232	0.9660 % MBKPW 0.966 09/21/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	80.60%	3'081'470.67	0.18	a)
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	1'300	0	0	1'300 EUR	85.76%	1'065'576.83	0.06	a)
XS2410367747	2.8800 % TELEFO 2.88 PERP	3'100	0	0	3'100 EUR	85.88%	2'544'309.25	0.15	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.
X52412267358	1.0000 % ATIM 1 11/25/26 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	7'500	0	0	7'500 EUR	68.12%	4'883'181.39	0.29 a)	
X52434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	7'300	0	0	7'300 EUR	87.75%	6'122'185.57	0.36 a)	
X52436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	81.27%	2'330'112.75	0.14 a)	
X52437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	86.11%	1'810'664.12	0.11 a)	
X52439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	5'400	0	1'900	3'500 EUR	75.19%	2'515'015.71	0.15 a)	
X52451803063	5.3750 % BAYNGR 5 3/8 03/25/2082	5'600	0	0	5'600 EUR	93.65%	5'012'248.84	0.30 a)	
X52455392584	2.6250 % SABSM 2 5/8 03/24/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	96.10%	4'592'491.94	0.27 a)	
X52462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	600	0	0	600 EUR	103.70%	594'669.48	0.04 a)	
X52464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	4'800	0	0	4'800 EUR	92.22%	4'230'611.05	0.25 a)	
X52466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	6'800	0	0	6'800 EUR	87.82%	5'707'407.13	0.34 a)	
X52486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	95.82%	6'410'488.53	0.38 a)	
X52528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	5'600	0	0	5'600 EUR	98.30%	5'261'070.99	0.31 a)	
X52536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	100.69%	2'694'654.43	0.16 a)	
X52549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	3'700	0	0	3'700 EUR	104.95%	3'711'190.14	0.22 a)	
X52554581830	7.0000 % ASRNED 7 12/07/43	2'000	0	0	2'000 EUR	105.77%	2'021'761.15	0.12 a)	
X52560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	6'600	0	1'600	5'000 EUR	99.36%	4'747'895.87	0.28 a)	
X52560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	3'900	0	0	3'900 EUR	98.85%	3'684'572.68	0.22 a)	
X52575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	10'000	0	2'000	8'000 EUR	98.81%	7'554'733.58	0.45 a)	
X52576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	102.94%	1'475'735.21	0.09 a)	
X52591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	3'250	0	3'250 EUR	100.38%	3'117'815.22	0.18 a)	
X52592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	0	4'800	0	4'800 EUR	100.48%	4'609'452.11	0.27 a)	
X52592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	5'350	0	5'350 EUR	101.30%	5'179'547.48	0.31 a)	
X52595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	0	2'500	0	2'500 EUR	101.20%	2'417'983.82	0.14 a)	
X52598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	100.12%	3'636'039.05	0.21 a)	
X52609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	2'400	0	2'400 EUR	101.72%	2'333'215.09	0.14 a)	
X52626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	6'800	0	6'800 EUR	100.76%	6'548'320.15	0.39 a)	
X52626022573	4.1250 % WPPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 EUR	100.29%	1'821'106.76	0.11 a)	
X52629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	100.88%	1'542'585.66	0.09 a)	
X52644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	3'000	0	3'000 EUR	101.65%	2'914'597.82	0.17 a)	
<b>EUR</b>							<b>384'500'841.20</b>	<b>22.66</b>	
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	87.54%	1'952'791.15	0.12 a)	
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	86.08%	2'880'067.48	0.17 a)	
X50498768315	6.0000 % HSBC 6 03/29/40 EMTN	3'500	0	0	3'500 GBP	90.91%	3'548'742.80	0.21 a)	
X50730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	4'000	0	0	4'000 GBP	94.51%	4'216'180.11	0.25 a)	
X50903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	2'000	0	0	2'000 GBP	95.46%	2'129'482.13	0.13 a)	
X50932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	3'000	0	0	3'000 GBP	76.99%	2'575'916.29	0.15 a)	
X51242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	89.33%	1'992'630.83	0.12 a)	
X51472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 GBP	90.17%	8'045'830.56	0.47 a)	
X51492680902	2.1250 % CDTFIN 2 1/8 09/22/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	83.62%	1'865'304.46	0.11 a)	
X51492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	66.09%	1'474'157.34	0.09 a)	
X51891174424	3.7500 % DLR 3 3/4 10/17/30	2'500	0	0	2'500 GBP	84.19%	2'347'551.95	0.14 a)	
X52035363485	1.3750 % SANTAN 1 3/8 07/31/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	95.64%	2'133'452.71	0.13 a)	
X52170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	5'000	0	0	5'000 GBP	68.78%	3'835'851.71	0.23 a)	
X52195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	2'000	0	0	2'000 GBP	90.81%	2'025'733.90	0.12 a)	
X52244418609	1.0000 % ENELIM 1 10/20/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	82.22%	1'375'573.09	0.08 a)	
X52528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	5'600	0	0	5'600 GBP	98.56%	6'156'109.24	0.36 a)	
X52575900977	8.5000 % LLOYDS 8 1/2 PERP	2'000	0	0	2'000 GBP	95.77%	2'136'196.43	0.13 a)	
X52636324274	8.3750 % BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN	0	3'000	0	3'000 GBP	100.16%	3'351'451.96	0.20 a)	
<b>GBP</b>							<b>54'043'024.14</b>	<b>3.19</b>	
X51556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	360'000	0	0	360'000 JPY	100.46%	2'206'543.89	0.13 a)	
X51580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	100.01%	6'101'445.06	0.36 a)	
X51645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	360'000	0	0	360'000 JPY	99.73%	2'190'502.06	0.13 a)	
X51702964351	2.1080 % AFL 2.108 10/23/47	200'000	0	0	200'000 JPY	101.05%	1'233'077.00	0.07 a)	
<b>JPY</b>							<b>11'731'568.01</b>	<b>0.69</b>	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	89.18%	3'865'457.52	0.23 a)	
CH0286864027	6.8750 % UBS 6 7/8 PERP	5'000	0	0	5'000 USD	93.10%	4'035'186.75	0.24 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.
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	2'800	0	0	2'800 USD	77.25%	1'874'875.19	0.11	a)
IL0060001943	5.0000 % ISRELE 5 11/12/24 6	1'900	0	0	1'900 USD	98.62%	1'624'335.60	0.10	a)
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	3'000	0	0	3'000 USD	91.66%	2'383'638.12	0.14	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	10'000	0	0	10'000 USD	67.87%	5'883'571.01	0.35	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	3'540	0	0	3'540 USD	67.22%	2'062'807.23	0.12	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	88.43%	7'665'901.29	0.45	a)
US00287YBQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	5'000	0	0	5'000 USD	96.92%	4'200'928.47	0.25	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	5'800	4'200	0	10'000 USD	90.56%	7'849'846.86	0.46	a)
US00774MAX39	3.3000 % AER 3.3 01/30/32	4'000	0	0	4'000 USD	81.86%	2'838'344.29	0.17	a)
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	3'100	0	0	3'100 USD	97.30%	2'614'652.78	0.15	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	5'000	0	0	5'000 USD	61.42%	2'662'096.35	0.16	a)
US022095BM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	20'000	0	0	20'000 USD	69.66%	12'077'300.94	0.71	a)
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	10'000	0	0	10'000 USD	88.42%	7'664'601.02	0.45	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	10'000	0	0	10'000 USD	76.34%	6'617'879.64	0.39	a)
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	4'600	0	0	4'600 USD	89.60%	3'572'769.08	0.21	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	5'000	0	0	5'000 USD	97.11%	4'208'816.81	0.25	a)
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	1'450	0	0	1'450 USD	102.82%	1'292'315.15	0.08	a)
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	5'110	0	0	5'110 USD	71.12%	3'150'245.42	0.19	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	2'500	0	0	2'500 USD	86.14%	1'866'674.79	0.11	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	78.69%	3'410'621.33	0.20	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	3'400	0	0	3'400 USD	84.35%	2'486'039.12	0.15	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	7'000	0	0	7'000 USD	96.40%	5'849'261.08	0.34	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	5'019	0	0	5'019 USD	87.50%	3'806'662.60	0.22	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	5'300	0	0	5'300 USD	82.93%	3'809'919.31	0.22	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	12'000	0	0	12'000 USD	70.68%	7'352'483.00	0.43	a)
US034863AX89	2.6250 % AALLN 2 5/8 09/10/30 144A	5'000	0	0	5'000 USD	82.74%	3'586'245.14	0.21	a)
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	10'080	0	0	10'080 USD	103.08%	9'007'235.85	0.53	a)
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	1'505	3'495	0	5'000 USD	94.81%	4'109'302.43	0.24	a)
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000	0	0	15'000 USD	83.15%	10'811'916.65	0.64	a)
US037833BW97	4.5000 % AAPL 4 1/2 02/23/36	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	4'000	0	0	4'000 USD	95.47%	3'310'188.08	0.20	a)
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	13'200	0	5'700	7'500 USD	62.93%	4'091'055.23	0.24	a)
US04686E3K65	1.7300 % ATH 1.73 10/02/26 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	87.47%	3'791'081.79	0.22	a)
US052769AH94	2.4000 % ADSK 2.4 12/15/31	2'615	0	0	2'615 USD	82.07%	1'860'282.55	0.11	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	5'100	0	1'100	4'000 USD	96.47%	3'345'070.13	0.20	a)
US05578UAA25	5.7000 % BPCEGP 5.7 10/22/23 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	99.73%	2'593'450.50	0.15	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	5'000	0	0	5'000 USD	78.38%	3'397'098.47	0.20	a)
US06051GFH74	4.2000 % BAC 4.2 08/26/24 MTN	5'090	0	0	5'090 USD	98.33%	4'338'405.16	0.26	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	10'000	0	0	10'000 USD	92.03%	7'977'967.29	0.47	a)
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	10'000	0	0	10'000 USD	87.50%	7'585'110.87	0.45	a)
US06051GHX07	2.8840 % BAC 2.884 10/22/30 MTN	1'405	2'595	0	4'000 USD	86.56%	3'001'381.44	0.18	a)
US06051GIW06	3.3110 % BAC 3.311 04/22/42	7'000	0	0	7'000 USD	77.04%	4'674'566.64	0.28	a)
US06368EDC30	0.9490 % BMO 0.949 01/22/27 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	89.54%	3'881'017.48	0.23	a)
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	7'500	0	0	7'500 USD	93.87%	6'102'775.70	0.36	a)
US06407FE11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	7'750	0	0	7'750 USD	90.31%	6'067'306.36	0.36	a)
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	8'000	0	0	8'000 USD	82.63%	5'730'225.24	0.34	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	6'000	0	0	6'000 USD	81.70%	4'249'454.73	0.25	a)
US06675FAZ09	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 144A	0	5'000	0	5'000 USD	98.15%	4'253'936.35	0.25	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	6'000	0	0	6'000 USD	86.15%	4'480'747.65	0.26	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	0	5'000	0	5'000 USD	91.26%	3'955'393.21	0.23	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	5'000	0	0	5'000 USD	80.81%	3'502'594.11	0.21	a)
US0778PFAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	6'000	0	0	6'000 USD	74.24%	3'861'348.65	0.23	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	7'000	0	0	7'000 USD	82.53%	5'007'636.42	0.30	a)
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	0	5'000 USD	95.25%	4'128'546.50	0.24	a)
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	90.99%	3'943'604.05	0.23	a)
US10112RBF01	2.4500 % BXP 2.45 10/01/33	4'900	0	0	4'900 USD	72.35%	3'073'070.80	0.18	a)
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	5'000	0	0	5'000 USD	93.19%	4'039'174.26	0.24	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	10'000	0	0	10'000 USD	91.11%	7'897'696.98	0.47	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	2'250	0	0	2'250 USD	79.43%	1'549'193.14	0.09	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'600	0	0	2'600 USD	91.06%	2'052'319.39	0.12	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.
US161175BX17	2.3000 % CHTR 2.3 02/01/32	6'000	0	0	6'000 USD	75.63%	3'933'591.93	0.23	a)
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33 144A	0	6'000	0	6'000 USD	101.19%	5'262'733.04	0.31	a)
US172967HB08	5.5000 % C 5 1/2 09/13/25	6'000	0	0	6'000 USD	99.45%	5'172'389.93	0.30	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	3'000	0	0	3'000 USD	97.03%	2'523'209.64	0.15	a)
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	6'000	0	0	6'000 USD	92.74%	4'823'240.09	0.28	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	3'700	0	0	3'700 USD	83.47%	2'677'138.80	0.16	a)
US191216DC18	2.5000 % KO 2 1/2 03/15/51	5'000	5'000	0	10'000 USD	66.96%	5'804'080.86	0.34	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	5'000	0	0	5'000 USD	88.56%	3'838'455.14	0.23	a)
US191241AJ70	1.8500 % KOF 1.85 09/01/32	2'250	0	0	2'250 USD	78.14%	1'524'052.33	0.09	a)
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	2'000	0	0	2'000 USD	94.96%	1'646'373.53	0.10	a)
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	9'242	0	0	9'242 USD	82.53%	6'611'430.71	0.39	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	10'000	0	0	10'000 USD	79.15%	6'861'117.75	0.40	a)
US219868CC84	2.3750 % CAF 2 3/8 05/12/23	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US224044CJ43	3.5000 % COXENT 3 1/2 08/15/27 144A	1'675	0	0	1'675 USD	92.97%	1'349'958.07	0.08	a)
US22822VAR24	3.3000 % CCI 3.3 07/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	88.01%	1'525'760.02	0.09	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	8'500	0	0	8'500 USD	81.32%	5'991'987.93	0.35	a)
US23355LAM81	2.3750 % DXC 2 3/8 09/15/28	5'000	0	0	5'000 USD	84.62%	3'667'729.04	0.22	a)
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	91.20%	3'952'792.66	0.23	a)
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	89.89%	3'895'840.61	0.23	a)
US24422EVP14	1.5000 % DE 1 1/2 03/06/28 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	86.79%	3'761'825.60	0.22	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	0	5'000	0	5'000 USD	99.72%	4'321'940.73	0.25	a)
US24703DBG51	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51 144A	8'000	0	0	8'000 USD	66.95%	4'642'640.56	0.27	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	8'000	0	0	8'000 USD	101.42%	7'033'204.81	0.41	a)
US249670AB66	3.3750 % DEPTCC 3 3/8 PERP D	3'250	0	0	3'250 USD	74.54%	2'099'931.12	0.12	a)
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	3'600	0	0	3'600 USD	78.03%	2'434'926.17	0.14	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	2'000	0	0	2'000 USD	92.44%	1'602'701.63	0.09	a)
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	4'118	0	0	4'118 USD	94.12%	3'359'933.42	0.20	a)
US25470DAR08	3.9500 % WBD 3.95 03/20/28	2'000	0	0	2'000 USD	93.34%	1'618'148.90	0.10	a)
US26442UAP93	4.0000 % DUK 4 04/01/52	2'250	0	0	2'250 USD	80.84%	1'576'713.47	0.09	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	6'100	0	0	6'100 USD	94.68%	5'006'210.45	0.30	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	3'500	0	0	3'500 USD	83.45%	2'531'912.82	0.15	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	2'300	0	0	2'300 USD	80.73%	1'609'518.54	0.09	a)
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	1'700	0	0	1'700 USD	95.65%	1'409'585.65	0.08	a)
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	5'000	0	0	5'000 USD	78.51%	3'402'863.02	0.20	a)
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	2'000	0	0	2'000 USD	88.20%	1'529'140.74	0.09	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	84.26%	2'921'457.87	0.17	a)
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	6'000	0	0	6'000 USD	89.96%	4'679'065.59	0.28	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	5'615	0	0	5'615 USD	91.98%	4'477'000.26	0.26	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	0	1'100	0	1'100 USD	102.58%	978'088.53	0.06	a)
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	2'600	0	0	2'600 USD	101.10%	2'278'601.91	0.13	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	4'100	0	1'100	3'000 USD	98.52%	2'562'035.85	0.15	a)
US37045XEHS2	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	1'700	0	1'700 USD	100.41%	1'479'701.68	0.09	a)
US375558BX02	1.2000 % GILD 1.2 10/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	86.59%	3'753'113.76	0.22	a)
US377373AH85	3.3750 % GSK 3 3/8 06/01/29	5'000	0	0	5'000 USD	93.14%	4'036'963.79	0.24	a)
US38141GWB66	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	10'000	0	0	10'000 USD	95.42%	8'271'135.96	0.49	a)
US38141GWQ36	3.2720 % GS 3.272 09/29/25	8'000	0	0	8'000 USD	97.00%	6'726'825.35	0.40	a)
US404280AW98	4.3000 % HSBC 4.3 03/08/26	4'000	0	0	4'000 USD	97.01%	3'363'828.76	0.20	a)
US404280DL07	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/02/36	3'000	0	0	3'000 USD	99.75%	2'594'100.64	0.15	a)
US437076CC49	3.3000 % HD 3.3 04/15/40	7'000	3'000	0	7'000 USD	80.83%	4'904'481.27	0.29	a)
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	1'750	0	0	1'750 USD	92.10%	1'397'175.83	0.08	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	3'300	0	0	3'300 USD	84.37%	2'413'378.01	0.14	a)
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	75.83%	3'944'150.16	0.23	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	3'550	0	0	3'550 USD	94.42%	2'905'572.41	0.17	a)
US458140CA64	4.1500 % INTC 4.15 08/05/32	8'000	0	0	8'000 USD	94.90%	6'581'125.20	0.39	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	3'900	0	0	3'900 USD	88.74%	3'000'012.68	0.18	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	9'800	0	0	9'800 USD	95.88%	8'145'300.55	0.48	a)
US46647PAF36	3.5400 % JPM 3.54 05/01/28	8'000	0	0	8'000 USD	93.59%	6'490'209.97	0.38	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	86.77%	2'256'445.22	0.13	a)
US46647PBP09	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	7'000	0	0	7'000 USD	85.92%	5'213'825.36	0.31	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.
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	5'000	0	0	5'000 USD	75.76%	3'283'627.80	0.19	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	4'500	0	0	4'500 USD	84.35%	3'290'228.86	0.19	a)
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	0	5'000	0	5'000 USD	100.72%	4'365'543.29	0.26	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	12'000	0	0	12'000 USD	86.69%	9'017'459.14	0.53	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	5'100	0	0	5'100 USD	80.84%	3'573'707.02	0.21	a)
US48124BAC90	8.5491 % JPM FLOAT PERP Q	3'400	0	3'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	0	650	0	650 USD	100.50%	566'275.40	0.03	a)
US49456BAR24	2.0000 % KMI 2 02/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	79.62%	3'451'016.54	0.20	a)
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	10'000	5'000	0	15'000 USD	84.87%	11'035'043.84	0.65	a)
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US514886AC47	7.6250 % LBBW 7 5/8 02/01/23	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	0	5'000	0	5'000 USD	63.59%	2'755'976.21	0.16	a)
US53944YAF07	4.4500 % LLOYDS 4.45 05/08/25	7'000	3'000	0	10'000 USD	97.53%	8'454'301.37	0.50	a)
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'400	0	0	4'400 USD	81.09%	3'093'038.69	0.18	a)
US55903VAC72	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24 144A	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAW37	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24	0	5'000	0	5'000 USD	98.50%	4'269'279.59	0.25	a)
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	10'000	0	0	10'000 USD	84.42%	7'318'294.44	0.43	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	5'000	0	0	5'000 USD	91.91%	3'983'782.55	0.23	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	99.80%	3'287'376.06	0.19	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	10'000	0	0	10'000 USD	82.57%	7'157'927.19	0.42	a)
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	84.83%	3'676'570.91	0.22	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	3'450	0	0	3'450 USD	90.26%	2'699'434.61	0.16	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	0	1'700	0	1'700 USD	97.75%	1'440'473.25	0.08	a)
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	8'000	0	0	8'000 USD	71.15%	4'933'763.46	0.29	a)
US58933YBM66	5.0000 % MRK 5 05/17/53	0	1'300	0	1'300 USD	100.36%	1'130'928.16	0.07	a)
US59156RBZ01	4.5500 % MET 4.55 03/23/30	5'000	0	0	5'000 USD	97.96%	4'245'614.59	0.25	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	2'100	0	0	2'100 USD	95.41%	1'736'902.14	0.10	a)
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	13'722	0	0	13'722 USD	68.23%	8'116'019.93	0.48	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	6'278	5'000	0	11'278 USD	72.95%	7'131'542.58	0.42	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	5'000	0	0	5'000 USD	79.46%	3'443'995.05	0.20	a)
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	5'000	3'000	0	8'000 USD	94.12%	6'527'103.11	0.38	a)
US61747YEK73	2.4750 % MS 2.475 01/21/28	8'000	0	0	8'000 USD	90.48%	6'274'260.30	0.37	a)
US61772BAC72	3.2170 % MS 3.217 04/22/42	8'000	0	0	8'000 USD	75.57%	5'240'697.71	0.31	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	8'000	0	0	8'000 USD	81.69%	5'665'315.51	0.33	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	2'700	0	0	2'700 USD	96.10%	2'249'122.08	0.13	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	4'000	0	4'000 USD	100.18%	3'473'641.67	0.20	a)
US637639AB13	1.5000 % NSCCLF 1 1/2 04/23/25 144A	5'000	0	0	5'000 USD	93.72%	4'062'059.10	0.24	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	88.61%	1'536'300.92	0.09	a)
US641062AS38	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 144A	5'000	0	0	5'000 USD	85.99%	3'727'194.95	0.22	a)
US64952XCS80	3.0000 % NYLIFE 3 01/10/28 REGS	7'850	0	0	7'850 USD	92.05%	6'263'725.04	0.37	a)
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	83.11%	3'602'238.52	0.21	a)
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	15'000	0	0	15'000 USD	82.23%	10'691'511.19	0.63	a)
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	90.43%	3'919'505.62	0.23	a)
US68389XBE40	3.9000 % ORCL 3.9 05/15/35	8'000	4'000	0	12'000 USD	86.09%	8'955'045.94	0.53	a)
US6944PM2E61	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	84.06%	7'286'827.79	0.43	a)
US713448CT37	2.7500 % PEP 2 3/4 04/30/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	0	10'000	0	10'000 USD	70.40%	6'102'277.26	0.36	a)
US71427QAA67	1.2500 % RIFP 1 1/4 04/01/28 144A	8'000	0	0	8'000 USD	84.94%	5'890'349.77	0.35	a)
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	6'000	0	6'000 USD	102.72%	5'342'413.89	0.31	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	8'500	0	0	8'500 USD	89.44%	6'590'140.44	0.39	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	2'000	0	0	2'000 USD	93.71%	1'624'702.28	0.10	a)
US74340XCB55	2.2500 % PLD 2 1/4 01/15/32	3'000	0	0	3'000 USD	80.95%	2'105'249.25	0.12	a)
US744320AY89	3.9050 % PRU 3.905 12/07/47	7'753	0	0	7'753 USD	80.20%	5'390'193.44	0.32	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	6'000	0	0	6'000 USD	84.68%	4'404'395.50	0.26	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	6'800	0	0	6'800 USD	85.30%	5'028'312.52	0.30	a)
US747525BP77	1.6500 % QCOM 1.65 05/20/32	5'071	0	0	5'071 USD	78.50%	3'450'524.30	0.20	a)
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	4'000	0	0	4'000 USD	100.79%	3'494'827.13	0.21	a)
US775109BB60	5.0000 % RCICN 5 03/15/44	0	5'000	0	5'000 USD	87.42%	3'788'827.98	0.22	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	0	4'400	0	4'400 USD	98.71%	3'765'013.88	0.22	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	2'200	0	0	2'200 USD	86.29%	1'645'686.99	0.10	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	4'700	0	0	4'700 USD	96.70%	3'939'705.82	0.23	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.
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	4'000	0	0	4'000 USD	84.77%	2'939'280.31	0.17	a)
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	93.63%	8'116'316.55	0.48	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	5'900	0	0	5'900 USD	101.58%	5'195'069.32	0.31	a)
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	6'000	0	0	6'000 USD	74.80%	3'890'162.75	0.23	a)
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	99.74%	2'593'866.59	0.15	a)
US86964WAK80	3.1250 % SUZANO 3 1/8 01/15/32 DM3N	3'000	0	0	3'000 USD	80.33%	2'088'891.79	0.12	a)
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	0	5'000	0	5'000 USD	69.28%	3'002'595.03	0.18	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	88.03%	3'815'396.93	0.22	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	8'000	0	0	8'000 USD	83.10%	5'762'888.15	0.34	a)
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	4'900	0	0	4'900 USD	82.23%	3'492'730.22	0.21	a)
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	83.30%	3'610'560.28	0.21	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	5'550	0	0	5'550 USD	83.00%	3'993'240.75	0.24	a)
US891160MJ94	3.6250 % TD 3 5/8 09/15/31	4'000	0	2'000	2'000 USD	93.09%	1'613'918.67	0.10	a)
US912797FS14	0.0000 % B 06/13/24	0	10'000	0	10'000 USD	95.75%	8'300'339.07	0.49	a)
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	0	20'000	0	20'000 USD	98.08%	17'004'288.89	1.00	a)
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	14'000	0	0	14'000 USD	83.28%	10'106'656.16	0.60	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	2'666	0	0	2'666 USD	96.03%	2'219'274.52	0.13	a)
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	5'000	0	0	5'000 USD	93.25%	4'041'558.10	0.24	a)
US92343VFW90	2.9870 % VZ 2.987 10/30/56	0	5'000	0	5'000 USD	61.48%	2'664'610.22	0.16	a)
US92343VGK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	10'000	0	0	10'000 USD	75.99%	6'586'759.73	0.39	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	5'000	0	0	5'000 USD	70.25%	3'044'767.28	0.18	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	5'000	0	0	5'000 USD	67.63%	2'931'426.65	0.17	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000	0	0	10'000 USD	92.73%	8'038'040.00	0.47	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	5'000	0	0	5'000 USD	94.96%	4'115'933.83	0.24	a)
US928563AD71	4.5000 % VMW 4 1/2 05/15/25	3'200	0	0	3'200 USD	97.91%	2'716'000.55	0.16	a)
US92857WBU36	4.2500 % VOD 4 1/4 09/17/50	5'000	0	0	5'000 USD	79.53%	3'446'899.00	0.20	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	5'000	0	0	5'000 USD	97.41%	4'221'992.93	0.25	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	85.25%	2'955'958.50	0.17	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	5'000	0	2'750	2'250 USD	95.54%	1'863'385.09	0.11	a)
US958102AQ89	2.8500 % WDC 2.85 02/01/29	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	3'300	0	0	3'300 USD	85.93%	2'458'117.88	0.14	a)
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'600	0	0	2'600 USD	89.14%	2'009'113.85	0.12	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	2'200	0	0	2'200 USD	104.23%	1'987'815.34	0.12	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	0	2'500	0	2'500 USD	84.61%	1'833'647.81	0.11	a)
USF1067PAD80	9.2500 % BNP 9 1/4 PERP REGS	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	3'000	0	0	3'000 USD	76.56%	1'990'981.08	0.12	a)
USF84914CU62	7.3750 % SOCGEN 7 3/8 PERP REGS	5'000	0	2'500	2'500 USD	99.20%	2'149'701.32	0.13	a)
USF8500RAA08	5.3750 % SOCGEN 5 3/8 PERP REGS	0	3'000	0	3'000 USD	79.30%	2'062'236.15	0.12	a)
USF8500RAB80	4.7500 % SOCGEN 4 3/4 PERP REGS	0	2'500	0	2'500 USD	84.19%	1'824'437.52	0.11	a)
USF8500RAC63	9.3750 % SOCGEN 9 3/8 PERP REGS	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	6'500	0	0	6'500 USD	94.58%	5'329'302.78	0.31	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	0	3'800	0	3'800 USD	99.20%	3'267'710.70	0.19	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	4'900	0	0	4'900 USD	88.98%	3'779'483.34	0.22	a)
USG7420TAD84	2.7500 % RKTLN 2 3/4 06/26/24 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	97.47%	3'379'570.76	0.20	a)
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	78.31%	3'394'151.18	0.20	a)
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	8'800	0	0	8'800 USD	89.75%	6'846'228.73	0.40	a)
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	77.56%	2'554'882.61	0.15	a)
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	97.24%	1'348'652.16	0.08	a)
USH4209UAT37	7.0000 % UBS 7 PERP REGS	6'000	0	0	6'000 USD	98.16%	5'105'295.74	0.30	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	100.74%	1'222'522.02	0.07	a)
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	91.43%	1'585'087.24	0.09	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	4'300	0	0	4'300 USD	97.03%	3'616'712.31	0.21	a)
USN82008AX66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	90.74%	3'932'725.08	0.23	a)
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	89.68%	3'886'825.37	0.23	a)
USPOR80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	3'450	0	0	3'450 USD	91.33%	2'731'314.76	0.16	a)
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	6'000	0	0	6'000 USD	76.27%	3'966'930.98	0.23	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALC5W 5 3/8 12/06/32 REGS	800	0	0	800 USD	100.90%	699'735.19	0.04	a)
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'956	0	0	1'956 USD	83.52%	1'416'130.54	0.08	a)
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	7'000	0	0	7'000 USD	82.07%	4'979'663.17	0.29	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.
USU3149FAB59	2.3750 % FMEGR 2 3/8 02/16/31 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU3644QAD70	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	4'500	5'000	0	9'500 USD	66.82%	5'502'677.12	0.32	a)
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	89.47%	3'877'723.45	0.23	a)
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	6'000	0	0	6'000 USD	77.09%	4'009'475.98	0.24	a)
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	89.39%	3'099'474.19	0.18	a)
USY3815NBF79	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 01/24/27 REGS	4'300	0	4'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	101.84%	4'414'000.20	0.26	a)
USY68856AN67	3.5000 % PETMK 3 1/2 03/18/25 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	96.85%	4'197'764.47	0.25	a)
USY68856AV83	4.5500 % PETMK 4.55 04/21/50 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	77.78%	2'359'704.40	0.14	a)
X51253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	8'000	0	0	8'000 USD	96.29%	6'677'380.22	0.39	a)
X51550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	97.13%	4'209'943.71	0.25	a)
X51650033571	5.0000 % BOAD 5 07/27/27 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	92.91%	3'221'630.69	0.19	a)
X51681539539	4.1250 % STOUA 4 1/8 09/14/27 EMTN	1'200	0	0	1'200 USD	92.98%	967'238.16	0.06	a)
X51888180640	6.2500 % VOD 6 1/4 10/03/2078	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51951093894	7.5000 % SANTAN 7 1/2 PERP	3'000	0	0	3'000 USD	97.14%	2'526'252.29	0.15	a)
X51956051145	6.7500 % INTNED 6 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 USD	96.84%	3'357'726.14	0.20	a)
X52049422343	4.2500 % SRENVX 4 1/4 PERP	12'000	0	0	12'000 USD	91.78%	9'546'619.05	0.56	a)
X52075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	7'200	0	0	7'200 USD	95.18%	5'940'425.96	0.35	a)
X52076169668	5.1250 % SEB 5 1/8 PERP	3'800	0	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52233263404	4.3750 % SHBASS 4 3/8 PERP	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52283175516	1.4560 % STANLN 1.456 01/14/27 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	89.62%	3'884'181.48	0.23	a)
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	10'000	0	0	10'000 USD	78.94%	6'842'567.16	0.40	a)
X52403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	14'300	0	0	14'300 USD	84.85%	10'517'595.94	0.62	a)
X52416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	5'900	0	0	5'900 USD	79.79%	4'080'842.87	0.24	a)
X52465969132	3.5000 % KORWAT 3 1/2 04/27/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.51%	836'622.94	0.05	a)
X52532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	1'400	0	0	1'400 USD	103.40%	1'254'900.60	0.07	a)
X52585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	0	3'000	0	3'000 USD	94.15%	2'448'339.81	0.14	a)
<b>USD</b>							<b>1'053'360'469.18</b>	<b>62.08</b>	

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

**88'217'555.22 5.20**

#### Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

**88'217'555.22 5.20**

1U2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	1'002	0	1'002	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	0	1'002	0	1'002 CHF	88'006.34	88'217'555.22	5.20	a)

**CHF 88'217'555.22 5.20**

#### Derivative Finanzinstrumente

**16'094'327.97 0.95**

#### Futures

**0.00 0.00**

03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	-500	500	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	800	800	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	0	200	-200 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	EURO-BOBL FUTURE SEP23	0	0	200	-200 EUR	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

EUR/CHF	Verfall 24.02.2023	169'309'576	172'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.02.2023	500'553'130	539'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 24.02.2023	6'872'334	7'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.02.2023	6'411'811	7'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.02.2023	9'157'040	10'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 24.02.2023	10'003'410	10'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.02.2023	3'704'416	4'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 23.03.2023	239'218'320	240'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 23.03.2023	40'335'409	59'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 23.03.2023	10'421'633	16'300'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 23.03.2023	53'876'976	48'000'000		CHF/GBP	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.
JPY/CHF	Verfall 23.03.2023		14'162'507	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.03.2023		564'244'050	615'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		182'335'815	185'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		484'483'125	525'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		7'969'512	8'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 25.05.2023		13'874'001	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 25.05.2023		40'510'320	60'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.05.2023		579'017'884	628'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 25.05.2023		53'168'139	47'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 25.05.2023		222'600'672	224'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 25.05.2023		10'266'834	16'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 25.05.2023		14'000'000	12'407'794		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 25.05.2023		12'000'000	11'760'480		EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 22.06.2023		201'763'198	206'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.06.2023		507'089'100	570'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.06.2023		17'638'660	20'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 20.07.2023		12'830'807	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.07.2023		206'081'334	213'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 20.07.2023		9'855'403	16'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 20.07.2023		39'754'200	60'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 20.07.2023		52'262'543	47'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.07.2023		540'952'885	605'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 20.07.2023		2'275'704	2'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 20.07.2023		3'000'000	2'927'514		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 20.07.2023		1'000'000	897'117		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 20.07.2023		7'000'000	6'830'705		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 20.07.2023		5'000'000	4'874'320		EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.08.2023		534'381'600	600'000'000		CHF/USD	15'560'612.02	0.92	b)
EUR/CHF	Verfall 24.08.2023		205'271'430	210'000'000		CHF/EUR	4'832'447.89	0.28	b)
USD/CHF	Verfall 24.08.2023		8'544'290	10'000'000		CHF/USD	-102'354.63	-0.01	b)
CHF/EUR	Verfall 24.08.2023		5'000'000	4'787'865		EUR/CHF	-15'610.52	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 21.09.2023		12'270'362	1'970'000'000		CHF/JPY	220'152.40	0.01	b)
AUD/CHF	Verfall 21.09.2023		9'668'006	16'600'000		CHF/AUD	7'161.79	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 21.09.2023		54'693'996	49'000'000		CHF/GBP	330'604.92	0.02	b)
EUR/CHF	Verfall 21.09.2023		195'243'573	203'000'000		CHF/EUR	1'792'761.78	0.11	b)
CAD/CHF	Verfall 21.09.2023		38'795'820	60'000'000		CHF/CAD	-531'012.25	-0.03	b)
USD/CHF	Verfall 21.09.2023		539'757'201	633'000'000		CHF/USD	-6'000'435.43	-0.35	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>16'094'327.97</b>	<b>0.95</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	18'415'284.11	1.09
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'555'613'152.71	91.68
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	88'217'555.22	5.20
Derivative Finanzinstrumente	16'094'327.97	0.95
Sonstige Vermögenswerte	18'354'621.89	1.08
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'696'694'941.90</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-303'785.24	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'696'391'156.66</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'643'830'707.93	96.88
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	16'094'327.97	0.95
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>136'600'597.40</b>	<b>8.05</b>
AU3CB0247401 3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	4'400 AUD 98.30%	2'526'465.54 0.15
BE0002950310 4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	1'400 EUR 100.17%	1'340'356.02 0.08
DE000A289FK7 2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	1'000 EUR 71.78%	686'013.73 0.04
DE000A30VT97 10.0000 % DB 10 PERP	2'000 EUR 102.37%	1'956'827.92 0.12

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.07.2023 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'200 EUR	85.30%	978'322.21	0.06
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	1'600 USD	77.25%	1'071'357.25	0.06
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	6'100 EUR	80.85%	4'713'584.67	0.28
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	2'000 USD	96.92%	1'680'371.39	0.10
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	1'000 USD	88.42%	766'460.10	0.05
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	1'100 USD	84.35%	804'306.77	0.05
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	4'000 USD	81.70%	2'832'969.82	0.17
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	1'000 USD	83.47%	723'551.03	0.04
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	1'000 USD	88.56%	767'691.03	0.05
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	5'600 USD	101.42%	4'923'243.37	0.29
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	1'000 USD	78.03%	676'368.38	0.04
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	4'000 USD	94.12%	3'263'655.58	0.19
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	1'000 USD	98.52%	854'011.95	0.05
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	1'000 USD	75.83%	657'358.36	0.04
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'000 USD	94.42%	818'471.10	0.05
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	1'000 USD	75.76%	656'725.56	0.04
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'810 USD	99.80%	1'565'829.12	0.09
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	8'000 USD	71.15%	4'933'763.46	0.29
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	1'600 USD	72.95%	1'011'745.71	0.06
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	310 USD	96.10%	258'232.53	0.02
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	400 USD	100.18%	347'364.17	0.02
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	5'100 USD	102.72%	4'541'051.80	0.27
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	2'515 USD	100.79%	2'197'372.56	0.13
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	2'800 USD	98.71%	2'395'917.92	0.14
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	800 USD	84.77%	587'856.06	0.03
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	635 USD	93.63%	515'386.10	0.03
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'000 USD	101.58%	1'761'040.45	0.10
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	1'000 USD	74.80%	648'360.46	0.04
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	1'000 USD	99.74%	864'622.20	0.05
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	1'000 USD	83.30%	722'112.06	0.04
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	5'006 USD	83.00%	3'601'831.20	0.21
US912797FS14	0.0000 % B 06/13/24	10'000 USD	95.75%	8'300'339.07	0.49
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	20'000 USD	98.08%	17'004'288.89	1.00
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	3'100 USD	85.93%	2'309'141.04	0.14
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'600 USD	89.14%	2'009'113.85	0.12
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	2'500 USD	76.56%	1'659'150.90	0.10
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	2'000 USD	88.98%	1'542'646.26	0.09
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	3'800 USD	89.75%	2'956'326.04	0.17
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	1'000 USD	77.56%	672'337.53	0.04
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	750 USD	97.24%	632'180.70	0.04
USH4209UAT37	7.0000 % UBS 7 PERP REGS	1'500 USD	98.16%	1'276'323.93	0.08
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	500 USD	91.43%	396'271.81	0.02
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	3'770 USD	89.68%	2'930'666.33	0.17
USPOR80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	1'894 USD	91.33%	1'499'452.22	0.09
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	500 USD	76.27%	330'577.58	0.02
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'281 USD	83.52%	927'435.19	0.05
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	4'900 USD	66.82%	2'838'222.93	0.17
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	3'000 USD	77.09%	2'004'737.99	0.12
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	5'000 USD	101.84%	4'414'000.20	0.26
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500 USD	77.78%	2'359'704.40	0.14
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	1'000 USD	96.29%	834'672.53	0.05
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	1'000 USD	97.13%	841'988.74	0.05
XS1640903701	4.7500 % HSBC 4 3/4 PERP EMTN	2'400 EUR	86.39%	1'981'646.67	0.12
XS1951093894	7.5000 % SANTAN 7 1/2 PERP	1'000 USD	97.14%	842'084.10	0.05
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	2'000 EUR	80.34%	1'535'669.89	0.09
XS2189784288	6.1250 % CMZB 6 1/8 PERP	1'000 EUR	92.87%	887'599.19	0.05
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	1'000 EUR	89.54%	855'792.04	0.05
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	7'300 EUR	82.17%	5'733'152.00	0.34
XS2283175516	1.4560 % STANLN 1.456 01/14/27 REGS	2'900 USD	89.62%	2'252'825.26	0.13
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	100 EUR	84.35%	80'613.16	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.07.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
XS2386220698	1.3750 % LLY 1 3/8 09/14/61	2'824 EUR	51.52%	1'390'427.28	0.08	
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	1'000 USD	84.85%	735'496.22	0.04	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	1'000 USD	79.79%	691'668.28	0.04	
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	1'300 EUR	75.19%	934'148.69	0.06	
XS2554581830	7.0000 % ASRNED 7 12/07/43	650 EUR	105.77%	657'072.37	0.04	
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	2'000 USD	94.15%	1'632'226.54	0.10	

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

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

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.58412687
CAD	1 = CHF	0.65857550
EUR	1 = CHF	0.95574372
GBP	1 = CHF	1.11533255
JPY	100 = CHF	0.61011400
USD	1 = CHF	0.86685000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	4'325'012.80	2.956
Bond	CHF	141'983'074.65	97.044
Total	CHF	146'308'087.45	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	1'630'243'449.41	96.101
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	4'748'970.33	0.280
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## 6 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	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	136'600'597.40
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.02.2023 - 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	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000
BA CHF	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000
CT CHF	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000
DA CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
DT CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000
MT CHF	-	-	-	-	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.

## 9 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 23) Anpassung der Nachkommastellen von 2 auf 4 per 16.12.2021.
- 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.

## 12 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, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend

hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der 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 Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.