

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND USA GOVT.

Halbjahresbericht per 31.08.2023

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Index Fund V
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
FA USD	31562127	USD
GT USD	56649814	USD
NT USD	11704519	USD

Rechnungswährung: USD

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	12
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Fussnoten	15
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

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	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	31.08.2023	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		690'030'870.24	504'098'548.63	362'152'358.10	379'601'555.85
Klasse FA USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'137'556.67	13'964'357.57	2'630'837.11	2'562'803.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		162'553.855	158'431.709	26'334.664	24'753.210
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		86.9715	88.1412	99.9002	103.5342
Ausschüttung je Anteil		-	1.65	1.80	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse GT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		30'067'272.14	59'194'992.54	5'807'979.85	5'301'486.84
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		359'243.239	706'459.225	61'995.225	55'220.601
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.6961	83.7911	93.6843	96.0056
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		73.9246	78.5332	85.9507	86.9139
Thesaurierung je Anteil		-	1.58	1.62	1.81
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		645'826'041.43	430'939'198.52	353'713'541.14	371'737'265.69
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'874'500.544	3'916'257.870	2'877'456.055	2'953'489.010
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.9372	110.0385	122.9258	125.8638
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		97.1020	103.1336	112.7783	113.9445
Thesaurierung je Anteil		-	2.24	2.30	2.58
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	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

	2023	2022	2021	2020
Klasse FA USD	-2.13 %	-12.63 %	-2.43 %	7.79 %
Klasse GT USD (Lancierung 08.09.2020)	-2.09 %	-12.59 %	-2.39 %	-0.85 %
Klasse NT USD	-1.95 %	-12.47 %	-2.25 %	7.98 %
Benchmark	-2.02 %	-12.61 %	-2.30 %	7.98 %
Tracking Error 33)	-	0.09 %	0.04 %	0.04 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA USD	-0.11 %
Klasse GT USD (Lancierung 08.09.2020)	-0.07 %
Klasse NT USD	0.07 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2023	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	23'977'758.01	1'200'931.77
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	662'672'940.84	536'734'524.58
Sonstige Vermögenswerte	3'385'858.01	2'301'363.06
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	690'036'556.86	540'236'819.41
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-36'130'014.43
Andere Verbindlichkeiten	-5'686.62	-8'256.35
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	690'030'870.24	504'098'548.63

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA USD	von bis	01.03.2023 31.08.2023	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		158'431.709	26'334.664
Ausgegebene Anteile		54'979.486	152'573.073
Zurückgenommene Anteile		-50'857.340	-20'476.028
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		162'553.855	158'431.709

Klasse GT USD	von bis	01.03.2023 31.08.2023	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		706'459.225	61'995.225
Ausgegebene Anteile		270'074.014	678'749.000
Zurückgenommene Anteile		-617'290.000	-34'285.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		359'243.239	706'459.225

Klasse NT USD	von bis	01.03.2023 31.08.2023	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'916'257.870	2'877'456.055
Ausgegebene Anteile		2'727'281.097	1'072'514.067
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	7'871.823
Zurückgenommene Anteile		-769'038.423	-41'584.075
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'874'500.544	3'916'257.870

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 31.08.2023	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		504'098'548.63	362'152'358.10
Ausbezahlte Ausschüttung		-279'409.62	-62'439.43
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'004'712.52	-2'621'015.79
Saldo aus dem Anteilverkehr		185'507'944.12	182'037'448.66
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		4'708'499.63	-37'407'802.91
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		690'030'870.24	504'098'548.63

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 31.08.2023	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		40'217.21	16'524.67
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-196.40
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		6'906'244.00	8'167'905.91
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'810'492.70	2'120'822.90
Total Ertrag		8'756'953.91	10'305'057.08
Aufwand			
Passivzinsen		-3.72	0.00
Reglementarische Vergütungen		-43'857.69	-54'748.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-346'416.26	-88'726.47
Total Aufwand		-390'277.67	-143'475.22
Nettoertrag / Verlust		8'366'676.24	10'161'581.86
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-6'059'698.35	-1'438'359.06
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		229'222.30	135'356.93
Realisierter Erfolg		2'536'200.19	8'858'579.73
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'172'299.44	-46'266'382.64
Gesamterfolg		4'708'499.63	-37'407'802.91

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							662'672'940.84	96.03	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							662'672'940.84	96.03	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	351	0	0	351 USD	102.61%	360'158.92	0.05	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	441	0	0	441 USD	106.56%	469'940.63	0.07	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	280	250	0	530 USD	104.25%	552'525.00	0.08	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	398	0	0	398 USD	111.55%	443'956.58	0.06	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	500	0	0	500 USD	107.41%	537'031.25	0.08	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	400	100	0	500 USD	104.45%	522'265.60	0.08	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	305	130	0	435 USD	109.28%	475'373.44	0.07	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	350	125	0	475 USD	102.34%	486'132.81	0.07	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	550	70	180	440 USD	103.53%	455'537.50	0.07	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	401	100	0	501 USD	91.89%	460'372.01	0.07	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	542	225	0	767 USD	100.22%	768'677.81	0.11	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	762	0	0	762 USD	103.00%	784'860.00	0.11	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	618	230	0	848 USD	101.36%	859'527.54	0.12	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	644	200	0	844 USD	104.34%	880'661.25	0.13	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	543	300	0	843 USD	101.14%	852'615.43	0.12	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	743	145	100	788 USD	94.86%	747'491.91	0.11	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	697	130	0	827 USD	99.50%	822'865.00	0.12	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	608	415	130	893 USD	105.56%	942'673.13	0.14	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	613	225	0	838 USD	100.66%	843'499.38	0.12	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	760	185	120	825 USD	92.56%	763'640.63	0.11	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	485	400	0	885 USD	84.31%	746'165.63	0.11	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	932	160	220	872 USD	83.94%	731'683.19	0.11	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	674	225	0	899 USD	82.00%	737'180.00	0.11	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	695	250	0	945 USD	78.56%	742'415.63	0.11	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	1'278	220	155	1'343 USD	78.34%	1'052'156.56	0.15	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	870	300	0	1'170 USD	83.00%	971'100.00	0.14	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'635	725	150	2'210 USD	79.56%	1'758'331.25	0.25	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	1'042	350	0	1'392 USD	89.28%	1'242'795.00	0.18	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	1'078	485	163	1'400 USD	90.88%	1'272'250.00	0.18	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	1'402	300	210	1'492 USD	89.13%	1'329'745.00	0.19	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	1'115	482	214	1'383 USD	85.67%	1'184'842.10	0.17	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	1'551	511	283	1'779 USD	82.19%	1'462'115.63	0.21	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	1'100	461	0	1'561 USD	80.41%	1'255'141.56	0.18	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	1'500	892	322	2'070 USD	73.36%	1'518'539.17	0.22	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	1'025	150	219	956 USD	80.06%	765'397.50	0.11	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	964	637	167	1'434 USD	78.16%	1'120'760.63	0.16	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	680	99	0	779 USD	79.84%	621'982.81	0.09	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	1'560	612	450	1'722 USD	72.66%	1'251'140.63	0.18	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	1'230	468	0	1'698 USD	72.58%	1'232'376.48	0.18	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	1'862	746	515	2'093 USD	68.84%	1'440'899.69	0.21	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	920	133	150	903 USD	77.72%	701'800.31	0.10	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	1'794	819	710	1'903 USD	79.47%	1'512'290.31	0.22	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	1'050	389	0	1'439 USD	79.44%	1'143'105.63	0.17	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'950	719	619	2'050 USD	75.75%	1'552'875.00	0.23	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'706	660	300	2'066 USD	75.69%	1'563'703.75	0.23	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	2'080	590	305	2'365 USD	79.34%	1'876'479.69	0.27	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	2'113	1'317	844	2'586 USD	81.19%	2'099'508.75	0.30	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	2'267	1'479	970	2'776 USD	79.33%	2'202'148.61	0.32	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'408	787	345	2'850 USD	84.95%	2'421'163.92	0.35	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'587	2'013	1'711	2'889 USD	79.34%	2'292'240.94	0.33	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	2'550	599	220	2'929 USD	77.53%	2'270'890.31	0.33	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	2'110	649	0	2'759 USD	68.00%	1'876'120.00	0.27	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	2'350	1'730	891	3'189 USD	69.91%	2'229'310.31	0.32	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	2'490	765	0	3'255 USD	64.00%	2'083'200.00	0.30	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	3'480	1'122	818	3'784 USD	52.25%	1'977'140.00	0.29	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'558	1'576	170	4'964 USD	54.02%	2'681'335.38	0.39	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'720	1'050	587	3'183 USD	61.34%	1'952'571.56	0.28	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'130	900	430	2'600 USD	61.84%	1'607'937.50	0.23	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	3'546	1'303	627	4'222 USD	57.80%	2'440'184.27	0.35	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	2'900	1'200	660	3'440 USD	63.80%	2'194'612.67	0.32	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	4'050	1'794	1'137	4'707 USD	61.67%	2'902'895.39	0.42	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	4'110	1'090	1'037	4'163 USD	69.34%	2'886'780.31	0.42	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	3'920	1'825	305	5'440 USD	69.50%	3'780'800.00	0.55	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'970	1'480	286	4'164 USD	73.64%	3'066'395.42	0.44	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'970	968	245	4'693 USD	63.45%	2'977'791.47	0.43	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	4'339	1'550	1'160	4'729 USD	67.16%	3'175'819.06	0.46	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'680	898	210	4'368 USD	61.42%	2'682'907.72	0.39	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	3'400	1'375	224	4'551 USD	69.94%	3'182'855.63	0.46	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'410	2'172	1'611	3'971 USD	67.47%	2'679'184.06	0.39	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'864	990	594	3'260 USD	74.38%	2'424'625.00	0.35	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	3'200	779	180	3'799 USD	77.63%	2'948'973.75	0.43	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'303	1'410	885	2'828 USD	85.36%	2'413'963.27	0.35	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	3'100	743	235	3'608 USD	79.70%	2'875'688.57	0.42	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	2'327	830	662	2'495 USD	86.77%	2'164'802.22	0.31	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	3'021	1'945	1'279	3'687 USD	96.50%	3'557'955.00	0.52	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	1'936	1'510	1'001	2'445 USD	94.84%	2'318'929.69	0.34	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	1'200	2'547	140	3'607 USD	90.09%	3'249'681.56	0.47	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	1'000	1'750	245	2'505 USD	93.03%	2'330'432.81	0.34	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	3'607	0	3'607 USD	90.17%	3'252'499.71	0.47	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	0	2'550	0	2'550 USD	93.00%	2'371'500.00	0.34	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	1'500	0	1'500 USD	98.66%	1'479'840.00	0.21	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	0	1'100	0	1'100 USD	99.73%	1'097'074.00	0.16	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	3'454	1'235	1'385	3'304 USD	91.66%	3'028'322.50	0.44	a)
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	909	0	909	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	2'050	710	0	2'760 USD	92.31%	2'547'825.00	0.37	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	1'034	600	0	1'634 USD	96.59%	1'578'341.88	0.23	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	1'200	0	0	1'200 USD	96.64%	1'159'687.44	0.17	a)
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	394	929	0	1'323 USD	96.58%	1'277'342.22	0.19	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	2'430	375	0	2'805 USD	91.95%	2'579'285.02	0.37	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	1'400	0	0	1'400 USD	96.23%	1'347'281.32	0.20	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	1'230	360	0	1'590 USD	96.22%	1'529'878.13	0.22	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	1'250	480	0	1'730 USD	96.38%	1'667'287.50	0.24	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	2'794	1'625	510	3'909 USD	93.66%	3'661'022.81	0.53	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	1'300	300	0	1'600 USD	96.61%	1'545'750.08	0.22	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	800	0	0	800 USD	96.30%	770'375.04	0.11	a)
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	1'350	250	0	1'600 USD	96.58%	1'545'249.92	0.22	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'570	1'327	834	4'063 USD	93.98%	3'818'585.36	0.55	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	1'280	145	0	1'425 USD	96.47%	1'374'679.69	0.20	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'200	2'338	1'495	4'043 USD	93.75%	3'790'312.50	0.55	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	1'400	285	295	1'390 USD	95.98%	1'334'182.88	0.19	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	1'080	200	0	1'280 USD	96.38%	1'233'600.00	0.18	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	1'350	0	375	975 USD	96.31%	939'046.88	0.14	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	3'473	2'562	2'181	3'854 USD	94.66%	3'648'051.88	0.53	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	1'150	450	0	1'600 USD	96.00%	1'536'000.00	0.22	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	930	300	0	1'230 USD	95.38%	1'173'112.50	0.17	a)
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	1'350	0	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	1'450	275	0	1'725 USD	95.28%	1'643'601.56	0.24	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'085	1'567	990	3'662 USD	92.06%	3'371'328.75	0.49	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	1'450	210	0	1'660 USD	94.94%	1'575'962.50	0.23	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'450	175	0	1'625 USD	94.28%	1'532'070.31	0.22	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	1'570	500	2'070	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	1'050	175	0	1'225 USD	94.44%	1'156'859.38	0.17	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'480	1'480	781	3'179 USD	90.56%	2'878'981.88	0.42	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	1'420	750	610	1'560 USD	93.69%	1'461'525.00	0.21	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	1'440	225	250	1'415 USD	92.98%	1'315'728.98	0.19	a)
US9128288B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	2'282	0	2'282	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	4'196	610	4'806	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	3'014	600	0	3'614 USD	96.45%	3'485'815.76	0.51	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	2'574	700	0	3'274 USD	95.63%	3'130'762.50	0.45	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	3'203	1'000	717	3'486 USD	94.66%	3'299'716.88	0.48	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	3'010	1'130	497	3'643 USD	94.72%	3'450'604.06	0.50	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'510	630	0	3'140 USD	92.94%	2'918'237.50	0.42	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	2'474	950	267	3'157 USD	92.47%	2'919'238.44	0.42	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	3'015	1'370	1'135	3'250 USD	92.59%	3'009'296.88	0.44	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'440	465	0	2'905 USD	92.97%	2'700'742.19	0.39	a)
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	1'070	0	1'070	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	1'606	0	1'606	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	2'096	900	2'996	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	1'180	0	1'180	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	2'800	1'445	741	3'504 USD	93.06%	3'260'910.00	0.47	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	2'971	250	0	3'221 USD	95.33%	3'070'518.75	0.44	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	1'661	585	2'246	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	917	380	1'297	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	1'290	280	420	1'150 USD	96.19%	1'106'156.25	0.16	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	1'300	0	0	1'300 USD	96.30%	1'251'859.44	0.18	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	1'283	590	1'873	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	1'440	311	228	1'523 USD	92.78%	1'412'872.88	0.20	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'830	1'150	500	3'480 USD	86.58%	3'012'918.58	0.44	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	1'144	375	0	1'519 USD	91.22%	1'385'612.81	0.20	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	1'350	0	0	1'350 USD	95.98%	1'295'789.13	0.19	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	930	225	0	1'155 USD	91.81%	1'060'434.38	0.15	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	1'400	0	0	1'400 USD	95.98%	1'343'781.32	0.19	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	2'462	250	953	1'759 USD	95.75%	1'684'242.50	0.24	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	1'083	395	0	1'478 USD	91.56%	1'353'293.75	0.20	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	2'068	500	355	2'213 USD	86.94%	1'923'926.88	0.28	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	1'452	975	1'020	1'407 USD	91.44%	1'286'525.63	0.19	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	1'900	160	0	2'060 USD	95.47%	1'966'656.25	0.29	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	1'316	225	0	1'541 USD	91.67%	1'412'663.67	0.20	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	2'010	0	0	2'010 USD	95.58%	1'921'120.21	0.28	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	1'800	0	0	1'800 USD	94.88%	1'707'750.00	0.25	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	4'140	1'485	786	4'839 USD	90.72%	4'389'880.31	0.64	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	2'740	970	0	3'710 USD	84.81%	3'146'543.75	0.46	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	613	400	0	1'013 USD	89.39%	905'526.98	0.13	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	2'210	1'095	1'124	2'181 USD	94.30%	2'056'614.95	0.30	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	1'300	250	170	1'380 USD	87.52%	1'207'715.56	0.18	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	2'000	720	0	2'720 USD	93.13%	2'533'000.00	0.37	a)
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'580	500	467	2'613 USD	92.64%	2'420'699.40	0.35	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	2'193	930	580	2'543 USD	86.84%	2'208'436.56	0.32	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	3'940	1'621	0	5'561 USD	79.31%	4'410'568.13	0.64	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	1'570	400	0	1'970 USD	86.61%	1'706'204.79	0.25	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	2'020	650	0	2'670 USD	92.14%	2'460'154.55	0.36	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	1'760	590	0	2'350 USD	86.39%	2'030'179.57	0.29	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	2'740	250	555	2'435 USD	91.89%	2'237'536.60	0.32	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'124	755	0	2'879 USD	91.58%	2'636'534.07	0.38	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	2'780	500	590	2'690 USD	85.69%	2'304'993.75	0.33	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	6'500	1'236	1'100	6'636 USD	78.78%	5'227'923.75	0.76	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	2'000	465	0	2'465 USD	85.91%	2'117'589.06	0.31	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'280	700	0	2'980 USD	91.28%	2'720'181.25	0.39	a)
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'449	1'450	383	3'516 USD	85.22%	2'996'291.25	0.43	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	2'650	800	0	3'450 USD	91.09%	3'142'734.38	0.46	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	3'045	975	350	3'670 USD	90.78%	3'331'671.88	0.48	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	2'130	1'760	912	2'978 USD	85.44%	2'544'328.75	0.37	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	5'370	2'945	1'298	7'017 USD	80.03%	5'615'792.81	0.81	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'410	1'850	1'026	3'234 USD	85.70%	2'771'638.90	0.40	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'690	450	0	3'140 USD	90.75%	2'849'550.00	0.41	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	2'750	1'500	450	3'800 USD	85.47%	3'247'812.50	0.47	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	2'697	930	0	3'627 USD	90.59%	3'285'835.31	0.48	a)
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	1'860	0	1'860	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	2'910	810	0	3'720 USD	90.23%	3'356'718.94	0.49	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	3'030	860	0	3'890 USD	85.75%	3'335'675.00	0.48	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'765	1'904	987	6'682 USD	81.23%	5'428'081.27	0.79	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'270	960	300	3'930 USD	87.05%	3'420'942.38	0.50	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	2'790	1'000	0	3'790 USD	90.28%	3'421'659.38	0.50	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	2'980	1'915	1'110	3'785 USD	87.38%	3'307'143.75	0.48	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	3'350	1'050	872	3'528 USD	90.75%	3'201'660.00	0.46	a)
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	3'530	1'450	1'355	3'625 USD	90.44%	3'278'359.38	0.48	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	3'300	1'320	535	4'085 USD	87.20%	3'562'247.45	0.52	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	5'550	2'765	1'578	6'737 USD	83.75%	5'642'237.50	0.82	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	3'011	1'265	350	3'926 USD	87.03%	3'416'846.88	0.50	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	2'870	1'375	406	3'839 USD	90.19%	3'462'298.13	0.50	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	4'000	1'200	1'150	4'050 USD	86.88%	3'518'437.50	0.51	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'640	1'000	252	3'388 USD	90.39%	3'062'434.21	0.44	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	2'630	0	2'620	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'631	1'150	150	3'631 USD	89.41%	3'246'340.94	0.47	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	2'829	800	0	3'629 USD	85.58%	3'105'629.97	0.45	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	6'150	2'041	958	7'233 USD	80.75%	5'840'647.50	0.85	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	1'800	1'000	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	3'870	1'260	1'295	3'835 USD	85.94%	3'295'703.13	0.48	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	3'010	1'230	297	3'943 USD	89.53%	3'530'217.19	0.51	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	1'500	2'050	0	3'550 USD	95.00%	3'372'500.00	0.49	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	2'820	1'237	200	3'857 USD	86.30%	3'328'470.66	0.48	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	2'900	1'445	680	3'665 USD	89.72%	3'288'192.19	0.48	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	1'900	1'775	0	3'675 USD	94.92%	3'488'379.09	0.51	a)
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	3'131	511	0	3'642 USD	86.67%	3'156'589.87	0.46	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	2'970	625	0	3'595 USD	90.14%	3'240'555.29	0.47	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	2'182	1'300	0	3'482 USD	94.75%	3'299'195.00	0.48	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	5'889	1'983	843	7'029 USD	81.03%	5'695'686.56	0.83	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	2'740	1'050	0	3'790 USD	90.31%	3'422'843.75	0.50	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	3'200	746	292	3'654 USD	87.11%	3'182'976.75	0.46	a)
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	3'386	0	0	3'386 USD	94.77%	3'208'763.89	0.47	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	2'923	625	0	3'548 USD	86.38%	3'064'585.00	0.44	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	3'090	1'750	567	4'273 USD	90.19%	3'853'711.88	0.56	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	1'470	2'000	0	3'470 USD	94.67%	3'285'114.24	0.48	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	2'980	1'109	734	3'355 USD	87.92%	2'950'042.84	0.43	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	5'690	2'270	410	7'550 USD	84.05%	6'345'539.44	0.92	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	2'500	780	0	3'280 USD	94.92%	3'113'437.66	0.45	a)
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	3'030	1'145	1'009	3'166 USD	88.42%	2'799'436.72	0.41	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'880	1'835	1'298	3'417 USD	91.73%	3'134'563.76	0.45	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	2'300	740	0	3'040 USD	95.09%	2'890'850.00	0.42	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'350	627	0	2'977 USD	90.67%	2'699'301.87	0.39	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	2'590	1'010	369	3'231 USD	93.69%	3'027'043.13	0.44	a)
US91282CEG24	2.2500 % T 2 1/4 03/31/24	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'088	700	0	2'788 USD	96.25%	2'683'450.00	0.39	a)
US91282CEK36	2.5000 % T 2 1/2 04/30/24	1'700	1'000	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	2'100	740	0	2'840 USD	93.05%	2'642'531.39	0.38	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	2'512	1'000	342	3'170 USD	94.39%	2'992'182.65	0.43	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	5'053	1'405	0	6'458 USD	90.86%	5'867'698.76	0.85	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	2'018	800	0	2'818 USD	96.34%	2'714'966.88	0.39	a)
US91282CER88	2.5000 % T 2 1/2 05/31/24	1'700	700	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	1'950	750	0	2'700 USD	92.34%	2'493'281.25	0.36	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	3'030	630	620	3'040 USD	93.88%	2'853'800.00	0.41	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	2'180	1'100	562	2'718 USD	96.45%	2'621'595.80	0.38	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	2'121	650	355	2'416 USD	94.81%	2'290'670.00	0.33	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	2'568	1'240	789	3'019 USD	96.00%	2'898'240.00	0.42	a)
US91282CEX56	3.0000 % T 3 06/30/24	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	1'920	805	0	2'725 USD	96.56%	2'631'328.13	0.38	a)
US91282CFA45	3.0000 % T 3 07/31/24	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	2'396	1'085	542	2'939 USD	94.13%	2'766'333.75	0.40	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	1'870	600	0	2'470 USD	91.56%	2'261'593.75	0.33	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	2'200	460	0	2'660 USD	96.73%	2'573'134.51	0.37	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	6'115	1'636	1'482	6'269 USD	89.75%	5'626'427.50	0.82	a)
US91282CFG15	3.2500 % T 3 1/4 08/31/24	4'000	850	1'782	3'068 USD	97.92%	3'004'243.28	0.44	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	3'030	800	1'062	2'768 USD	95.42%	2'641'277.64	0.38	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	1'699	645	0	2'344 USD	94.09%	2'205'557.50	0.32	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	1'700	785	0	2'485 USD	97.39%	2'420'156.91	0.35	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	2'150	130	0	2'280 USD	97.97%	2'233'687.50	0.32	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'140	750	0	2'890 USD	99.06%	2'862'906.25	0.41	a)
US91282CFN65	4.2500 % T 4 1/4 09/30/24	4'000	900	1'833	3'067 USD	98.88%	3'032'496.25	0.44	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	2'000	1'200	584	2'616 USD	98.88%	2'586'570.00	0.37	a)
US91282CFQ96	4.3750 % T 4 3/8 10/31/24	2'000	850	0	2'850 USD	98.94%	2'819'718.75	0.41	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	1'550	665	0	2'215 USD	98.64%	2'184'889.73	0.32	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	2'360	475	0	2'835 USD	99.08%	2'808'864.70	0.41	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	4'916	2'936	1'461	6'391 USD	99.94%	6'387'005.63	0.93	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	2'280	578	270	2'588 USD	99.38%	2'571'725.63	0.37	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	1'800	1'000	0	2'800 USD	99.06%	2'773'750.00	0.40	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	1'600	1'385	320	2'665 USD	97.98%	2'611'283.73	0.38	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	2'030	1'500	613	2'917 USD	98.17%	2'863'673.74	0.42	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	2'000	533	0	2'533 USD	98.38%	2'491'642.00	0.36	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'500	715	0	2'215 USD	97.97%	2'170'007.81	0.31	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	3'000	1'210	1'317	2'893 USD	98.17%	2'840'112.49	0.41	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	3'250	375	1'133	2'492 USD	98.77%	2'461'239.25	0.36	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	2'500	800	784	2'516 USD	98.11%	2'468'432.00	0.36	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	3'000	500	883	2'617 USD	98.58%	2'579'789.40	0.37	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	3'000	1'830	1'788	3'042 USD	96.72%	2'942'184.38	0.43	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	3'000	750	1'536	2'214 USD	95.91%	2'123'364.38	0.31	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	3'000	1'000	1'334	2'666 USD	98.41%	2'623'510.63	0.38	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	1'900	4'510	140	6'270 USD	95.23%	5'971'195.63	0.87	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	3'000	500	890	2'610 USD	99.30%	2'591'648.57	0.38	a)
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	0	3'050	0	3'050 USD	98.77%	3'012'351.41	0.44	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	0	2'713	460	2'253 USD	98.72%	2'224'133.44	0.32	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	0	2'572	0	2'572 USD	99.92%	2'569'990.75	0.37	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	0	2'215	0	2'215 USD	96.59%	2'139'551.56	0.31	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	0	2'950	0	2'950 USD	97.20%	2'867'492.04	0.42	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	0	2'825	0	2'825 USD	98.19%	2'773'796.88	0.40	a)
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	0	2'535	0	2'535 USD	97.83%	2'479'942.84	0.36	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	0	2'600	0	2'600 USD	98.19%	2'552'875.00	0.37	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	0	2'215	0	2'215 USD	95.88%	2'123'631.25	0.31	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	0	3'000	0	3'000 USD	96.69%	2'900'625.00	0.42	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	0	2'600	0	2'600 USD	97.52%	2'535'406.12	0.37	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	6'271	0	6'271 USD	94.20%	5'907'477.66	0.86	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	0	2'700	0	2'700 USD	98.78%	2'667'093.75	0.39	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	0	2'900	0	2'900 USD	97.27%	2'820'702.98	0.41	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	0	2'214	0	2'214 USD	97.30%	2'154'152.92	0.31	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	0	2'535	0	2'535 USD	98.84%	2'505'689.06	0.36	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	0	2'215	0	2'215 USD	97.31%	2'155'471.88	0.31	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	0	3'000	0	3'000 USD	98.81%	2'964'375.00	0.43	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	0	2'900	0	2'900 USD	99.45%	2'884'140.48	0.42	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	0	3'170	590	2'580 USD	99.83%	2'575'565.50	0.37	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	0	2'700	0	2'700 USD	99.73%	2'692'828.26	0.39	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	0	3'100	460	2'640 USD	99.42%	2'624'737.63	0.38	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	2'500	0	2'500 USD	98.81%	2'470'325.00	0.36	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	2'800	0	2'800 USD	98.20%	2'749'684.00	0.40	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	0	3'000	0	3'000 USD	99.54%	2'986'170.00	0.43	a)
USD							662'672'940.84	96.03	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/USD Verfall 06.07.2023	368'184	330'000	USD/CHF	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte				0.00	0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	23'977'758.01	3.47
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	662'672'940.84	96.03
Sonstige Vermögenswerte	3'385'858.01	0.49
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	690'036'556.86	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-5'686.62	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	690'030'870.24	

Bewertungskategorien

	Kurswert USD	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);	662'672'940.84	96.03
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

CHF	1 = USD	1.13218228
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)		-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)		-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 31.08.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.034	-	-	-
GT USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.034	-	-	-
NT USD	USD	0.00 - 0.08	-	0.034	-	-	-

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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: 01.03.2023 - 31.08.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FA USD	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT USD	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT USD	-	-	-	-	3.000

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

FTSE World Broad Investment-Grade US Dollar Corporate Bond Index TR

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 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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der 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, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer 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 Konstanzhaltung 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 Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.