

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. WORLD RESPONSIBLE

Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FAH1 CHF	114698092	CHF
GTH1 CHF	114698093	CHF
NTH1 CHF	114698094	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Fussnoten	16
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2024	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021
	bis	31.08.2024	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		559'682'071.29	457'499'075.67	371'458'815.45	210'181'072.21
Klasse FAH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'922'120.04	3'109'344.99	599'517.18	66'618.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		60'093.241	37'738.700	7'171.702	700.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		81.9080	82.3914	83.5948	95.1691
Ausschüttung je Anteil		-	2.30	2.60	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.22 %	0.22 %	0.22 %	0.22 %
Klasse GTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		942'518.19	677'793.43	456'433.84	296'189.17
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		11'061.000	8'055.000	5'458.000	3'112.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		85.2109	84.1457	83.6266	95.1765
Thesaurierung je Anteil		-	2.37	2.62	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		553'817'433.06	453'711'937.25	370'402'864.43	209'818'264.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'474'988.175	5'373'420.234	4'419'427.762	2'203'485.919
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		85.5318	84.4363	83.8124	95.2211
Thesaurierung je Anteil		-	2.54	2.79	0.03
Total Expense Ratio (Synthetische 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 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FAH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	2.25 %	3.97 %	-16.72 %	0.05 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	2.27 %	4.00 %	-16.69 %	0.06 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	2.37 %	4.20 %	-16.54 %	0.07 %
Benchmark Hedge	2.51 %	4.54 %	-16.86 %	-
Benchmark	-	-	-	-0.31 %
Tracking Error ³³⁾	-	0.27 %	0.34 %	0.40 %

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 FAH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	-0.26 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	-0.24 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.11.2021)	-0.14 %

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. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	29.02.2024
Bankguthaben auf Sicht	14'947'556.67	354'103.88
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	27'525'242.71	23'946'834.68
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	511'198'691.33	442'481'043.02
Sonstige Vermögenswerte	6'011'642.77	1'316'657.53
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	559'683'133.48	468'098'639.11
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-10'598'778.21
Andere Verbindlichkeiten	-1'062.19	-785.23
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	559'682'071.29	457'499'075.67

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von	01.03.2024	01.03.2023
Klasse FAH1 CHF	bis	31.08.2024	29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		37'738.700	7'171.702
Ausgegebene Anteile		22'681.518	30'992.170
Zurückgenommene Anteile		-326.977	-425.172
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		60'093.241	37'738.700

	von	01.03.2024	01.03.2023
Klasse GTH1 CHF	bis	31.08.2024	29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'055.000	5'458.000
Ausgegebene Anteile		4'625.000	3'137.000
Zurückgenommene Anteile		-1'619.000	-540.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		11'061.000	8'055.000

	von	01.03.2024	01.03.2023
Klasse NTH1 CHF	bis	31.08.2024	29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'373'420.234	4'419'427.762
Ausgegebene Anteile		639'889.499	1'425'260.344
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		553'580.900	-
Zurückgenommene Anteile		-91'902.458	-250'067.872
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-221'200.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		6'474'988.175	5'373'420.234

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	31.05.2024	2'267'910.69	26'943.158
Klasse NTH1 CHF	31.05.2024	44'329'152.63	526'637.742

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		457'499'075.67	371'458'815.45
Ausbezahlte Ausschüttung		-108'283.01	-21'584.43
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'412'818.17	-4'203'328.73
Saldo aus dem Anteilverkehr		93'570'039.18	80'353'071.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		14'134'057.62	9'912'101.56
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		559'682'071.29	457'499'075.67

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		8'539.71	16'290.84
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		122.60	-198.85
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		531'214.12	661'671.82
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		15'619'390.18	10'292'937.33
Sonstige Erträge		152'918.73	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'278'616.03	2'998'418.12
Total Ertrag		17'590'801.37	13'969'119.26
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-85.74
Reglementarische Vergütungen		-4'995.61	-4'164.88
Sonstige Aufwendungen		0.00	-22.69
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-180'363.61	-209'932.54
Total Aufwand		-185'359.22	-214'205.85
Nettoertrag / Verlust		17'405'442.15	13'754'913.41
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-4'706'163.96	-10'583'031.78
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		312'116.56	699'579.80
Realisierter Erfolg		13'011'394.75	3'871'461.43
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		1'122'662.87	6'040'640.13
Gesamterfolg		14'134'057.62	9'912'101.56

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							27'525'242.71	4.92	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							27'525'242.71	4.92	
BE0390118819	6.1510 % KBCBB 6.151 03/19/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.50%	113'180.15	0.02	a)
BE6295393936	2.2500 % ABIBB 2 1/4 05/24/29 EMTN	80	0	80	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
CH0330938876	2.7500 % UBS 2 3/4 08/08/25	100	0	0	100 GBP	97.81%	109'062.18	0.02	a)
CH1211713198	7.3750 % UBS 7 3/8 09/07/33	100	0	0	100 GBP	113.16%	126'183.05	0.02	a)
DE000A1G85D0	3.7500 % SIEGR 3 3/4 09/10/42 EMTN	0	100	0	100 GBP	86.10%	96'010.22	0.02	a)
DE000A1HG1L4	4.5000 % ALVGR 4 1/2 03/13/43 62	100	0	0	100 GBP	94.44%	105'306.61	0.02	a)
DE000A3LSV01	5.6250 % TRAGR 5 5/8 01/16/29 EMTN	100	100	100	100 GBP	100.48%	112'041.66	0.02	a)
FR0010039008	5.6250 % ORAFP 5 5/8 01/23/34 EMTN	40	0	0	40 GBP	104.98%	46'823.80	0.01	a)
FR0010379255	5.5000 % ENFP 5 1/2 10/06/26	50	0	0	50 GBP	101.51%	56'594.54	0.01	a)
FR0010680041	7.0000 % ENGIFP 7 10/30/28 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0010945436	5.1250 % EDF 5 1/8 09/22/50 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0010946855	5.0000 % ENGIFP 5 10/01/60 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.78%	100'112.59	0.02	a)
FR0011132356	5.5000 % EDF 5 1/2 10/17/41 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR0013396538	3.2500 % ORAFP 3 1/4 01/15/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.37%	100'772.71	0.02	a)
FR0013409166	2.2500 % DGFP 2 1/4 03/15/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.24%	105'085.82	0.02	a)
FR0013476330	1.8750 % BNP 1 7/8 12/14/27	100	200	0	300 GBP	90.94%	304'221.56	0.05	a)
FR0013482866	1.1250 % MCFP 1 1/8 02/11/27 EMTN	200	100	0	300 GBP	92.50%	309'433.43	0.06	a)
FR0014001GJ0	1.2500 % BNP 1 1/4 07/13/31 EMTN	0	100	0	100 GBP	78.56%	87'601.44	0.02	a)
FR0014001MX9	0.8750 % BFCM 0 7/8 12/07/27 EMTN	0	100	0	100 GBP	88.84%	99'065.53	0.02	a)
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.25%	105'095.86	0.02	a)
FR0014007UQ3	1.8750 % BFCM 1 7/8 10/26/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.41%	99'697.78	0.02	a)
FR001400E5E0	4.8750 % BFCM 4 7/8 09/25/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.66%	111'125.07	0.02	a)
FR001400F5X9	5.7500 % BNP 5 3/4 06/13/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.09%	114'949.78	0.02	a)
FR001400FAR2	4.8750 % ACAFP 4 7/8 10/23/29	100	0	0	100 GBP	100.49%	112'055.04	0.02	a)
FR001400FDG9	5.5000 % EDF 5 1/2 01/25/35 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FDH7	5.6250 % EDF 5 5/8 01/25/53 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H1V0	5.6250 % ENGIFP 5 5/8 04/03/53 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.45%	108'658.52	0.02	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.97%	115'935.51	0.02	a)
FR001400IKV7	6.3750 % ACAFP 6 3/8 06/14/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.13%	118'337.38	0.02	a)
FR001400ISF3	6.2500 % SOCGEN 6 1/4 06/22/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.90%	119'203.79	0.02	a)
FR001400L461	6.6250 % SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN	200	0	0	200 GBP	109.39%	243'962.89	0.04	a)
FR001400M6M1	5.1250 % KERFP 5 1/8 11/23/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.58%	112'150.94	0.02	a)
FR001400M6N9	5.0000 % KERFP 5 11/23/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.13%	110'532.97	0.02	a)
FR001400N624	5.3750 % ACAFP 5 3/8 01/15/29	100	0	0	100 GBP	100.88%	112'483.23	0.02	a)
XS0104440986	5.7500 % IILLN 5 3/4 12/03/32 EMTN	50	0	0	50 GBP	104.16%	58'071.45	0.01	a)
XS0121617517	5.7500 % WMT 5 3/4 12/19/30	80	0	0	80 GBP	107.94%	96'292.56	0.02	a)
XS0139563166	5.5000 % SSELN 5 1/2 06/07/32	60	0	0	60 GBP	103.81%	69'454.93	0.01	a)
XS0140198044	6.1250 % PRUFIN 6 1/8 12/19/31 EMTN	20	0	0	20 GBP	103.30%	23'036.34	0.00	a)
XS0140516864	5.2500 % GSK 5 1/4 12/19/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	105.62%	117'774.26	0.02	a)
XS0147048762	6.2500 % EOANGR 6 1/4 06/03/30 EMTN	50	0	0	50 GBP	106.45%	59'351.00	0.01	a)
XS0148579666	6.3750 % EOANGR 6 3/8 06/07/32 EMTN	70	0	0	70 GBP	108.07%	84'357.46	0.02	a)
XS0159497162	5.7500 % HSBC 5 3/4 12/20/27 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.52%	113'196.88	0.02	a)
XS0167358257	6.0000 % ARTFIN 6 09/30/33 EMTN	30	0	0	30 GBP	100.34%	33'564.33	0.01	a)
XS0168658853	5.1500 % C 5.15 05/21/26 EMTN	50	0	0	50 GBP	101.04%	56'334.17	0.01	a)
XS0202077953	5.2500 % WMT 5 1/4 09/28/35	100	0	0	100 GBP	105.52%	117'657.18	0.02	a)
XS0244171236	4.6250 % SSELN 4 5/8 02/20/37	50	0	0	50 GBP	94.07%	52'444.78	0.01	a)
XS0250116273	4.6740 % ASPR 4.674 03/31/40 B	50	0	0	50 GBP	96.69%	42'016.79	0.01	a)
XS0268693743	5.1250 % THAMES 5 1/8 09/28/37 EMTN	0	50	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0291949120	5.5000 % T 5 1/2 03/15/27	100	0	0	100 GBP	101.14%	112'777.61	0.02	a)
XS0294624373	5.2500 % GSK 5 1/4 04/10/42 EMTN	60	0	0	60 GBP	102.24%	68'401.18	0.01	a)
XS0301197546	5.1250 % UPS 5 1/8 02/12/50	0	50	0	50 GBP	101.03%	56'325.25	0.01	a)
XS0306772699	6.3750 % BRITEL 6 3/8 06/23/37 EMTN	0	50	0	50 GBP	107.77%	60'084.72	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X50327443627	5.8750 % EOANGR 5 7/8 10/30/37 EMTN	50	0	0	50 GBP	104.26%	58'127.21	0.01	a)
X50330497149	5.7500 % AZN 5 3/4 11/13/31 EMTN	50	0	0	50 GBP	108.88%	60'704.15	0.01	a)
X50340470490	6.8750 % GS 6 7/8 01/18/38	50	0	0	50 GBP	109.82%	61'229.35	0.01	a)
X50347920208	7.1250 % GS 7 1/8 08/07/25	50	0	0	50 GBP	101.78%	56'747.86	0.01	a)
X50350820931	6.3750 % GSK 6 3/8 03/09/39 EMTN	50	0	0	50 GBP	114.27%	63'707.05	0.01	a)
X50356452929	7.0000 % HSBC 7 04/07/38 EMTN	0	100	0	100 GBP	108.89%	121'414.99	0.02	a)
X50372391945	6.8000 % C 6.8 06/25/38 EMTN	50	0	0	50 GBP	115.76%	64'542.24	0.01	a)
X50379947236	7.0000 % BAC 7 07/31/28 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50383001053	6.4500 % HTHROW 6.45 12/10/31 REGS	50	100	0	150 GBP	107.38%	179'596.83	0.03	a)
X50388006123	7.0000 % CNALN 7 09/19/33 EMTN	80	0	0	80 GBP	112.44%	100'304.16	0.02	a)
X50399412443	8.1250 % ORAFP 8 1/8 11/20/28 EMTN	50	0	0	50 GBP	112.70%	62'834.50	0.01	a)
X50408958683	6.7500 % EOANGR 6 3/4 01/27/39 EMTN	100	0	0	100 GBP	111.94%	124'826.00	0.02	a)
X50416848793	6.8750 % EQNR 6 7/8 03/11/31 EMTN	50	0	0	50 GBP	112.71%	62'842.30	0.01	a)
X50426513387	7.0000 % T 7 04/30/40 EMTN	0	100	0	100 GBP	114.05%	127'174.35	0.02	a)
X50437306904	6.1250 % EOANGR 6 1/8 07/06/39 EMTN	0	100	0	100 GBP	105.99%	118'183.50	0.02	a)
X50439818039	6.3750 % KEL 6 3/8 08/19/39	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50451790280	5.7500 % KPN 5 3/4 09/17/29 GMTN	50	0	0	50 GBP	103.60%	57'759.79	0.01	a)
X50452187320	5.7500 % ENELIM 5 3/4 09/14/40 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50471436088	6.7500 % HTHROW 6 3/4 12/03/26 EMTN	150	0	0	150 GBP	103.63%	173'339.59	0.03	a)
X50473964509	6.6250 % AEGON 6 5/8 12/16/39 EMTN	50	0	0	50 GBP	113.35%	63'198.01	0.01	a)
X50497976562	5.7500 % WWUF 5 3/4 03/29/30	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50498768315	6.0000 % HSBC 6 03/29/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.97%	110'357.90	0.02	a)
X50519906761	5.7500 % AMXLMM 5 3/4 06/28/30	50	0	0	50 GBP	104.73%	58'388.14	0.01	a)
X50543369184	6.5000 % LLOYDS 6 1/2 09/17/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	114.71%	127'905.84	0.02	a)
X50545440900	5.4450 % TELEFO 5.445 10/08/29 EMTN	50	0	0	50 GBP	102.52%	57'159.32	0.01	a)
X50562326214	5.5000 % CMCSA 5 1/2 11/23/29	160	0	160	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50593975328	6.6970 % EVEHOL 6.697 02/22/35 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.20%	88'811.57	0.02	a)
X50625276257	5.8750 % HTHROW 5 7/8 05/13/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.18%	115'057.94	0.02	a)
X50627336323	5.7500 % NGGLN 5 3/4 04/16/32 EMTN	120	0	0	120 GBP	103.16%	138'038.75	0.02	a)
X50629875708	5.2500 % RABOBK 5 1/4 05/23/41 GMTN	50	0	0	50 GBP	103.45%	57'677.28	0.01	a)
X50710091140	5.5000 % AMGN 5 1/2 12/07/26	0	100	0	100 GBP	101.60%	113'295.01	0.02	a)
X50730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.07%	110'470.52	0.02	a)
X50742069726	4.3750 % MOTOPG 4 3/8 02/08/27 EMTN	0	100	0	100 GBP	99.00%	110'391.35	0.02	a)
X50785710046	4.8750 % T 4 7/8 06/01/44	100	0	0	100 GBP	90.04%	100'396.93	0.02	a)
X50800186222	4.6250 % THAMES 4 5/8 06/04/46 EMTN	0	100	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50812855277	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 08/07/41	100	0	0	100 GBP	88.57%	98'761.11	0.02	a)
X50827563452	5.2500 % RABOBK 5 1/4 09/14/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.99%	111'499.74	0.02	a)
X50829324457	4.0000 % AMGN 4 09/13/29	100	100	0	200 GBP	97.01%	216'340.24	0.04	a)
X50834641358	3.5000 % MET 3 1/2 09/30/26 GMTN	0	100	0	100 GBP	97.42%	108'626.19	0.02	a)
X50841542961	3.7500 % CAMBRG 3 3/4 10/17/52	100	0	0	100 GBP	82.40%	91'882.21	0.02	a)
X50866588527	3.3750 % GSK 3 3/8 12/20/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.45%	108'660.75	0.02	a)
X50888566519	4.3750 % HSRF 4 3/8 11/01/38 EMTN	0	100	0	100 GBP	93.58%	104'352.10	0.02	a)
X50932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	100	0	0	100 GBP	83.22%	92'791.00	0.02	a)
X51004042575	4.6250 % PEABDY 4 5/8 12/12/53	0	100	0	100 GBP	88.71%	98'916.11	0.02	a)
X51030900325	4.7500 % VZ 4 3/4 02/17/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.47%	108'685.29	0.02	a)
X51065371277	4.0000 % WELLTR 4 05/09/59	100	0	0	100 GBP	85.88%	95'763.79	0.02	a)
X51131276864	4.1250 % YORKFN 4 1/8 10/31/44	0	100	0	100 GBP	83.26%	92'836.72	0.02	a)
X51134541561	5.4530 % AXASA 5.453 PERP EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	0	100	0	100 GBP	96.10%	107'153.17	0.02	a)
X51269175466	3.0500 % AAPL 3.05 07/31/29	100	0	0	100 GBP	95.19%	106'141.80	0.02	a)
X51310962839	5.3750 % LGEN 5 3/8 10/27/45 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.47%	110'912.09	0.02	a)
X51319738537	6.1250 % RLMI 6 1/8 11/13/28	100	0	0	100 GBP	101.94%	113'673.02	0.02	a)
X51347435577	3.2500 % NWDIE 3 1/4 01/20/28 EMTN	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51371533867	3.5000 % THAMES 3 1/2 02/25/28 EMTN	0	100	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51377228959	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 03/10/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	87.99%	98'118.83	0.02	a)
X51468494239	3.3750 % VOD 3 3/8 08/08/49 EMTN	100	0	0	100 GBP	69.19%	77'153.18	0.01	a)
X51473485925	2.6250 % HSBC 2 5/8 08/16/28	100	0	0	100 GBP	91.94%	102'517.80	0.02	a)
X51488459485	4.3750 % AVLN 4 3/8 09/12/49 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.46%	104'218.29	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	70.91%	79'074.46	0.01	a)
XS1492681116	2.7500 % CDTFIN 2 3/4 09/22/46 EMTN	100	0	0	100 GBP	62.15%	69'297.48	0.01	a)
XS1529614726	2.7500 % SVTLN 2 3/4 12/05/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.77%	94'529.40	0.02	a)
XS1559392490	2.3990 % LANDLN 2.399 02/08/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.86%	101'311.29	0.02	a)
XS1587946911	2.6250 % URWFP 2 5/8 03/30/29	150	0	0	150 GBP	88.48%	147'999.50	0.03	a)
XS1608101652	1.8000 % PG 1.8 05/03/29	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1620778131	3.0430 % CLEF 3.043 06/30/50 A5	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1649231930	3.3000 % DLR 3.3 07/19/29	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1684269761	2.3750 % AKFAST 2 3/8 08/15/25 EMTN	0	100	0	100 GBP	96.80%	107'933.72	0.02	a)
XS1694801256	3.2500 % NOTHLL 3 1/4 10/12/48	100	0	0	100 GBP	71.50%	79'727.89	0.01	a)
XS1700429308	3.0000 % ARNDTN 3 10/16/29 EMTN	0	100	0	100 GBP	83.28%	92'866.83	0.02	a)
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	100	0	0	100 GBP	83.93%	93'587.16	0.02	a)
XS1713474838	2.5440 % OXUNIV 2.544 12/08/2117	100	0	0	100 GBP	53.10%	59'212.73	0.01	a)
XS1720922415	3.1250 % BRITEL 3 1/8 11/21/31 EMTN	0	100	0	100 GBP	88.68%	98'881.54	0.02	a)
XS1738994596	2.7350 % PFE 2.735 06/15/43 REG5	100	0	0	100 GBP	71.86%	80'131.55	0.01	a)
XS1748699011	3.2500 % BACR 3 1/4 01/17/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	85.39%	95'210.71	0.02	a)
XS1778775491	3.1250 % LONQUA 3 1/8 02/28/53	0	100	0	100 GBP	67.28%	75'023.39	0.01	a)
XS1787409033	3.2830 % SOUHSO 3.283 03/22/48	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1795261822	2.8750 % NWG 2 7/8 09/19/26 EMTN	100	100	0	200 GBP	97.53%	217'506.61	0.04	a)
XS1816338914	2.9200 % SANUK 2.92 05/08/26 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1843433712	2.2500 % FI 2 1/4 07/01/25	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1857917188	2.6070 % CONPLS 2.607 03/31/39	100	0	0	100 GBP	84.09%	79'142.82	0.01	a)
XS1859424902	3.1250 % GS 3 1/8 07/25/29 EMTN	50	0	0	50 GBP	93.45%	52'101.34	0.01	a)
XS1888925747	6.2500 % MGNLN 6 1/4 10/20/68	100	0	0	100 GBP	93.49%	104'245.05	0.02	a)
XS1893807120	3.5000 % NGGLN 3 1/2 10/16/26	100	0	0	100 GBP	97.00%	108'165.66	0.02	a)
XS1910948592	4.1250 % VW 4 1/8 11/17/31	0	100	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1948630634	3.1250 % DT 3 1/8 02/06/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	87.05%	97'070.66	0.02	a)
XS1953146245	3.0000 % INTNED 3 02/18/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.40%	108'603.88	0.02	a)
XS2004382136	1.6600 % TTEFP 1.66 07/22/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.96%	105'892.02	0.02	a)
XS2021481663	2.3750 % MOTOPG 2 3/8 07/03/39 EMTN	150	0	0	150 GBP	71.37%	119'367.71	0.02	a)
XS2029525693	1.6420 % WSTSTR 1.642 08/04/26	100	0	0	100 GBP	92.41%	103'046.35	0.02	a)
XS2049548527	2.3500 % GM 2.35 09/03/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.11%	108'286.09	0.02	a)
XS2052961740	1.2500 % NYLIFE 1 1/4 12/17/26 GMTN	100	0	0	100 GBP	92.82%	103'504.64	0.02	a)
XS2055110758	1.6250 % MET 1 5/8 09/21/29 GMTN	0	100	0	100 GBP	86.48%	96'436.18	0.02	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2120087452	1.7500 % SANTAN 1 3/4 02/17/27 EMTN	100	100	0	200 GBP	92.48%	206'253.27	0.04	a)
XS2150090764	3.2500 % EXPNLN 3 1/4 04/07/32 EMTN	0	100	0	100 GBP	91.07%	101'552.15	0.02	a)
XS2154346642	2.3750 % SANCTU 2 3/8 04/14/50	100	0	0	100 GBP	59.94%	66'837.62	0.01	a)
XS2166022934	4.5000 % LGEN 4 1/2 11/01/50	100	0	0	100 GBP	92.28%	102'896.93	0.02	a)
XS2176795677	3.7500 % BACR 3 3/4 11/22/30	100	0	0	100 GBP	97.48%	108'694.21	0.02	a)
XS2180916525	2.3750 % SWSFIN 2 3/8 05/28/28 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2181348405	4.0000 % AVLN 4 06/03/55	100	0	0	100 GBP	82.70%	92'215.62	0.02	a)
XS2193663619	4.2500 % BPLN 4 1/4 PERP	0	100	0	100 GBP	96.50%	107'604.78	0.02	a)
XS2194483330	2.7420 % EVEHOL 2.742 06/30/40 EMTN	100	0	0	100 GBP	84.57%	77'378.45	0.01	a)
XS2208621438	1.7500 % HYDEH 1 3/4 08/18/55	0	100	0	100 GBP	46.81%	52'194.45	0.01	a)
XS2228291279	1.0000 % RDSALN 1 12/10/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	81.75%	91'155.18	0.02	a)
XS2249596565	1.5000 % BNZLLN 1 1/2 10/30/30 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2251337601	1.8750 % VZ 1 7/8 11/03/38	0	100	0	100 GBP	66.71%	74'391.14	0.01	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	100	0	0	100 GBP	95.95%	106'988.14	0.02	a)
XS2266989149	1.6250 % CBGLN 1 5/8 12/03/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	78.61%	87'656.08	0.02	a)
XS2305547064	1.6250 % SGELN 1 5/8 02/25/31	100	0	0	100 GBP	81.66%	91'054.83	0.02	a)
XS2312756062	2.6250 % ISPIM 2 5/8 03/11/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	74.46%	83'032.98	0.01	a)
XS2322254322	1.5000 % GS 1 1/2 12/07/27 EMTN	60	0	0	60 GBP	90.18%	60'334.50	0.01	a)
XS2322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	100	0	0	100 GBP	94.04%	104'866.15	0.02	a)
XS2325617939	1.6250 % SWSFIN 1 5/8 03/30/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	82.79%	92'319.32	0.02	a)
XS2331739750	1.5000 % SANTAN 1 1/2 04/14/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.80%	105'704.69	0.02	a)
XS2335966557	1.8950 % JPM 1.895 04/28/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	82.14%	91'594.52	0.02	a)
XS2335989682	1.3750 % NATSER 1 3/8 03/31/31	100	0	0	100 GBP	88.10%	88'413.33	0.02	a)
XS2346516250	2.1050 % NWG 2.105 11/28/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.14%	103'857.01	0.02	a)
XS2354271095	0.6250 % NESNVX 0 5/8 12/18/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.01%	105'942.20	0.02	a)
XS2363709689	1.5000 % WELLTR 1 1/2 07/14/2071	100	0	0	100 GBP	38.64%	43'083.17	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2393629311	2.6250 % INVPLN 2 5/8 01/04/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.51%	100'924.36	0.02	a)
XS2403381069	1.8750 % TSCOLN 1 7/8 11/02/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.19%	99'458.04	0.02	a)
XS2405139432	2.0570 % NWG 2.057 11/09/28	100	0	0	100 GBP	91.47%	101'995.95	0.02	a)
XS2432519317	2.4210 % SANUK 2.421 01/17/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	91.63%	102'168.78	0.02	a)
XS2450201046	2.1250 % UNANA 2 1/8 02/28/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	93.24%	103'972.98	0.02	a)
XS2464724165	2.8750 % TD 2 7/8 04/05/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.01%	105'945.54	0.02	a)
XS2465774128	3.5000 % CABKSM 3 1/2 04/06/28	100	100	0	200 GBP	96.00%	214'094.48	0.04	a)
XS2465987621	2.8750 % BNS 2 7/8 05/03/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	94.89%	105'808.39	0.02	a)
XS2466406530	2.7500 % DGELN 2 3/4 06/08/38	100	0	0	100 GBP	79.06%	88'153.40	0.02	a)
XS2472657084	3.5840 % BAC 3.584 04/27/31	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2473721210	3.6250 % GS 3 5/8 10/29/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.14%	106'084.93	0.02	a)
XS2486285021	3.7500 % MCD 3 3/4 05/31/38 GMTN	100	0	0	100 GBP	86.77%	96'749.52	0.02	a)
XS2487052727	4.0800 % MQGAU 4.08 05/31/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.95%	108'111.02	0.02	a)
XS2490729154	3.6250 % RY 3 5/8 06/14/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.79%	107'927.03	0.02	a)
XS2496032108	3.9200 % TOYOTA 3.92 06/28/27 EMTN	0	100	0	100 GBP	98.13%	109'423.47	0.02	a)
XS2503832078	3.5500 % PEP 3.55 07/22/34	100	0	0	100 GBP	92.77%	103'450.01	0.02	a)
XS2521025408	4.0000 % DNBNO 4 08/17/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	98.13%	109'416.77	0.02	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.62%	107'740.82	0.02	a)
XS2528656080	5.8750 % ESBIRE 5 7/8 12/01/32	100	0	0	100 GBP	105.51%	117'648.26	0.02	a)
XS2531570112	5.3750 % ORSTED 5 3/8 09/13/42 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.82%	109'077.79	0.02	a)
XS2540612129	6.3750 % NWG 6 3/8 11/08/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.40%	116'410.53	0.02	a)
XS2550206333	6.3750 % NWGLN 6 3/8 10/28/34 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.31%	115'192.87	0.02	a)
XS2553549903	8.2010 % HSBC 8.201 11/16/34	100	0	0	100 GBP	109.79%	122'427.47	0.02	a)
XS2558389891	5.7890 % MS 5.789 11/18/33	100	0	0	100 GBP	104.60%	116'636.89	0.02	a)
XS2560496197	5.1250 % VOD 5 1/8 12/02/52 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.74%	101'179.71	0.02	a)
XS2569776136	5.1250 % YTLPMK 5 1/8 10/31/32	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2579493037	5.1250 % SANTAN 5 1/8 01/25/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.03%	112'653.84	0.02	a)
XS2580220171	8.4500 % AABOND 8.45 01/31/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.25%	118'476.76	0.02	a)
XS2582814385	5.7500 % BRITEL 5 3/4 02/13/41 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.11%	112'747.50	0.02	a)
XS2586741543	4.6250 % DANBNK 4 5/8 04/13/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	99.88%	111'368.16	0.02	a)
XS2591847970	6.6250 % LLOYDS 6 5/8 06/02/33 EMTN	100	100	0	200 GBP	102.37%	228'305.00	0.04	a)
XS2592017300	6.1250 % DB 6 1/8 12/12/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	102.63%	114'434.61	0.02	a)
XS2598063480	6.5000 % ISPIM 6 1/2 03/14/29 EMTN	150	150	0	300 GBP	103.05%	344'718.87	0.06	a)
XS2600822998	6.2500 % SKIPTN 6 1/4 04/25/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.64%	114'455.80	0.02	a)
XS2607194086	5.2500 % SVTLN 5 1/4 04/04/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.79%	109'042.11	0.02	a)
XS2608701574	5.1250 % UU 5 1/8 10/06/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	95.20%	106'152.95	0.02	a)
XS2620911128	5.7500 % NBHA 5 3/4 05/11/55 EMTN	0	100	0	100 GBP	99.52%	110'968.96	0.02	a)
XS2623504102	6.5000 % INCHLN 6 1/2 06/09/28	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2626254515	5.2500 % ABNANV 5 1/4 05/26/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.71%	112'293.67	0.02	a)
XS2629368999	5.5000 % SEB 5 1/2 06/01/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.55%	113'232.56	0.02	a)
XS2629395612	5.7730 % BPLN 5.773 05/25/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.21%	118'431.04	0.02	a)
XS2638082664	6.1250 % VLVY 6 1/8 06/22/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.59%	116'626.85	0.02	a)
XS2638381819	6.0000 % AWLN 6 06/20/39 GMTN	100	0	0	100 GBP	102.09%	113'835.82	0.02	a)
XS2641168997	5.7500 % UU 5 3/4 06/26/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.85%	114'679.93	0.02	a)
XS2642668821	9.5000 % OSBLN 9 1/2 09/07/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	108.16%	120'604.33	0.02	a)
XS2659226943	5.8180 % NGGLN 5.818 07/31/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.94%	113'667.44	0.02	a)
XS2667547876	5.6250 % MBGGR 5 5/8 08/17/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.55%	113'231.45	0.02	a)
XS2667626233	7.6250 % VMUKLN 7 5/8 08/23/29 GMTN	100	0	0	100 GBP	108.63%	121'125.07	0.02	a)
XS2667627124	5.7200 % CAT 5.72 08/17/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.94%	113'667.44	0.02	a)
XS2669894821	6.1250 % NWIDE 6 1/8 08/21/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.43%	116'442.86	0.02	a)
XS2671666688	6.5000 % DANBNK 6 1/2 08/23/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.63%	116'664.76	0.02	a)
XS2673526401	7.4820 % SANUK 7.482 08/29/29 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.63%	120'009.99	0.02	a)
XS2674597468	8.2500 % BBVASM 8 1/4 11/30/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	107.88%	120'288.76	0.02	a)
XS2675692664	7.3750 % YBS 7 3/8 09/12/27	100	0	0	100 GBP	103.90%	115'850.76	0.02	a)
XS2678149456	5.6000 % HNDA 5.6 09/06/30 EMTN	100	0	0	100 GBP	104.34%	116'344.74	0.02	a)
XS2678308516	5.7500 % MOTOPG 5 3/4 09/11/48 EMTN	100	0	0	100 GBP	105.19%	117'291.44	0.02	a)
XS2681391251	5.6250 % RKTLLN 5 5/8 12/14/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.34%	114'115.70	0.02	a)
XS2685873908	6.8000 % HSBC 6.8 09/14/31	100	0	0	100 GBP	108.12%	120'564.18	0.02	a)
XS2687917018	6.5000 % VW 6 1/2 09/18/27 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2689044258	5.2500 % NESNVX 5 1/4 09/21/26	100	0	0	100 GBP	101.30%	112'959.37	0.02	a)
XS2689046626	5.1250 % NESNVX 5 1/8 09/21/32	100	0	0	100 GBP	104.52%	116'546.57	0.02	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	100	0	0	100 GBP	104.56%	116'587.82	0.02	a)
XS2703627021	5.1250 % DE 5 1/8 10/18/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.61%	114'417.89	0.02	a)
XS2704925846	7.0000 % COVBS 7 11/07/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.48%	115'389.12	0.02	a)
XS2707602012	5.6250 % TOYOTA 5 5/8 10/23/28 EMTN	250	0	0	250 GBP	103.35%	288'096.46	0.05	a)
XS2711945878	7.0900 % BACR 7.09 11/06/29	100	0	0	100 GBP	106.74%	119'027.61	0.02	a)
XS2724943639	5.1250 % NESNVX 5 1/8 12/07/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	103.28%	115'161.64	0.02	a)
XS2725781509	6.2500 % NBHA 6 1/4 12/06/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	106.45%	118'695.32	0.02	a)
XS2729188644	5.3750 % PACLIF 5 3/8 11/30/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.49%	114'286.31	0.02	a)
XS2729355649	6.0000 % CAABNK 6 12/06/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.55%	113'235.91	0.02	a)
XS2730682528	4.9500 % NYLIFE 4.95 12/07/29	100	0	0	100 GBP	101.96%	113'695.32	0.02	a)
XS2731297235	7.3750 % SWSFIN 7 3/8 12/12/41	100	0	0	100 GBP	87.49%	97'559.06	0.02	a)
XS2741328681	5.5000 % SVNLN 5 1/2 01/24/57 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.46%	113'131.09	0.02	a)
XS2743029923	5.6250 % CDTFIN 5 5/8 01/11/36	100	0	0	100 GBP	99.86%	111'345.86	0.02	a)
XS2744491106	5.6250 % F 5 5/8 10/09/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	100.13%	111'653.62	0.02	a)
XS2747603624	5.5000 % SSELN 5 1/2 01/15/44 EMTN	0	100	0	100 GBP	98.80%	110'171.68	0.02	a)
XS2749469115	5.5000 % ANNGR 5 1/2 01/18/36 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.03%	108'192.42	0.02	a)
XS2790094523	5.8510 % BACR 5.851 03/21/35	0	100	0	100 GBP	100.67%	112'257.99	0.02	a)
XS2805328601	7.0190 % ROTHLF 7.019 12/10/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	102.06%	113'800.14	0.02	a)
XS2810268107	5.6250 % PLD 5 5/8 05/04/40	0	100	0	100 GBP	102.71%	114'527.17	0.02	a)
XS2824047372	5.1250 % TSCOLN 5 1/8 05/22/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.82%	109'078.91	0.02	a)
XS2828827449	5.7500 % UU 5 3/4 05/28/51 EMTN	0	100	0	100 GBP	97.63%	108'859.24	0.02	a)
XS2837824254	4.8800 % NWMLIC 4.88 12/12/29 GMTN	0	100	0	100 GBP	101.58%	113'271.59	0.02	a)
XS2845609226	5.6250 % UTGLN 5 5/8 06/25/32 EMTN	0	100	0	100 GBP	101.71%	113'409.86	0.02	a)

GBP							24'072'138.51	4.30	
JP316572CLC0	0.2800 % NTT 0.28 12/20/27 17	100'000	0	0	100'000 JPY	98.80%	575'702.86	0.10	a)
JP364300AP89	0.4390 % CENEXP 0.439 08/17/28 101	100'000	0	0	100'000 JPY	99.36%	578'971.85	0.10	a)
JP365820AP79	0.3690 % WESEXP 0.369 07/27/28 78	0	100'000	0	100'000 JPY	99.15%	577'753.99	0.10	a)
JP365820BM97	0.0400 % WESEXP 0.04 06/19/26 61	100'000	0	0	100'000 JPY	99.18%	577'934.63	0.10	a)
JP379990BL44	0.2250 % EASEXP 0.225 04/24/30 69	100'000	0	0	100'000 JPY	97.40%	567'579.93	0.10	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	98.71%	575'160.94	0.10	a)
JPY							3'453'104.20	0.62	

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

511'198'691.33 91.34

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

511'198'691.33 91.34

CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	1'272'207	301'449	122'367	1'451'290 EUR	122.15	166'494'198.53	29.75	a)
--------------	--	-----------	---------	---------	---------------	--------	----------------	-------	----

EUR 166'494'198.53 29.75

CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	2'633'664	612'194	196'618	3'049'240 USD	133.24	344'704'492.80	61.59	a)
--------------	--	-----------	---------	---------	---------------	--------	----------------	-------	----

USD 344'704'492.80 61.59

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF	Verfall 04.04.2024	143'897'603	151'320'000		CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 04.04.2024	21'569'345	19'425'000		CHF/GBP	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024	3'060'843	519'449'000		CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.04.2024	296'381'930	337'706'000		CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 04.04.2024	5'864'000	5'173'414		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.04.2024	4'154'000	3'975'930		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 04.04.2024	683'000	762'526		GBP/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.04.2024	2'733'986	3'100'000		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.04.2024	1'323'724	1'380'000		CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 04.04.2024	519'449'000	3'091'688		JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 04.04.2024	18'742'000	21'321'405		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 04.04.2024	334'942'000	301'632'353		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.04.2024	148'546'000	144'480'593		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 03.05.2024	519'593'000	3'028'448		JPY/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		3'093'755	519'110'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024		21'576'684	19'033'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.05.2024		302'875'568	337'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 07.05.2024		145'406'648	149'850'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		2'892	483'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 07.05.2024		32'911	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		7'072'000	6'386'016		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		3'178'000	3'093'551		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.05.2024		330'498'000	302'997'261		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 07.05.2024		146'672'000	143'806'909		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 07.05.2024		19'062'000	21'882'642		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		294'147'340	321'901'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		142'047'369	145'186'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2024		21'346'456	18'653'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		3'025'038	518'445'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		2'898'000	2'638'603		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		3'051'000	2'972'571		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2024		2'885	486'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		719'000	817'482		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2024		1'010'631	1'021'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2024		1'705'785	1'868'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2024		143'156'000	140'192'671		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2024		518'931'000	2'979'411		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2024		17'934'000	20'597'916		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2024		320'871'000	289'457'729		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		152'601'549	156'136'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		2'974'572	517'541'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		22'893'950	19'994'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		322'276'336	358'403'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		5'667'801	6'341'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		5'640'115	5'798'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		204'000	1'173		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		118'756	104'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		8'259'000	7'357'357		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		2'405'000	2'297'448		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		2'953'432	3'321'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		2'650'824	2'966'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		1'581'366	1'653'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2024		11'515'365	12'844'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.07.2024		5'468'565	5'709'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.07.2024		795'719	703'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.07.2024		488'862	87'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.07.2024		166'891'000	160'704'351		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.07.2024		604'837'000	3'378'680		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.07.2024		20'801'000	23'625'110		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2024		375'616'000	337'473'134		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		163'956'048	170'699'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.08.2024		3'393'334	606'827'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.08.2024		24'604'339	21'748'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		343'186'092	383'554'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		21'000	23'914		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		2'340'445	2'419'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.08.2024		486'000	2'721		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		2'277'807	2'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		3'222'000	2'892'641		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		2'065'000	2'006'028		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.08.2024		899'905	931'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.08.2024		541'955	611'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.08.2024		21'727'000	24'561'678		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.08.2024		606'341'000	3'547'459		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.08.2024		383'473'000	337'496'888		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.08.2024		171'984'000	163'803'237		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		24'842'496	22'048'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2024		3'550'963	606'432'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		342'006'016	389'998'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		165'767'902	174'429'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2024		2'154'516	2'301'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2024		8'677'961	10'137'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2024		88'833	81'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2024		400'135'000	339'398'508		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2024		176'730'000	165'943'461		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2024		606'432'000	3'533'766		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2024		22'129'000	24'669'542		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2024		344'845'802	407'907'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 03.10.2024		166'134'406	177'294'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.10.2024		3'550'007	608'766'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.10.2024		24'648'718	22'178'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	14'947'556.67	2.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	27'525'242.71	4.92
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	511'198'691.33	91.34
Sonstige Vermögenswerte	6'011'642.77	1.07
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	559'683'133.48	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-1'062.19	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	559'682'071.29	

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);	538'723'934.04	96.26
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

EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
JPY	100 = CHF	0.58270700
USD	1 = CHF	0.84845000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	540'872'428.68	96.639

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.473	-	-	-
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.473	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.57	-	0.473	-	-	-

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	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FAH1 CHF	0.220	0.550	0.170	0.050	3.000
GTH1 CHF	0.190	0.400	0.140	0.050	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	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 Corporate Bond Index

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der 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 Beträge 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.