

# SWISSCANTO (CH) INVESTMENT SOLUTIONS FUND I

**Halbjahresbericht per 30.11.2024**

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Übersicht Klassen	4
4	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible VV CHF	5
5	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18

# 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 Übersicht Klassen

#### Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible VV CHF

Rechnungswährung: CHF

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
GT CHF	38111100	CHF

## 4 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible VV CHF

### Übersicht

	von	01.06.2024	01.06.2023	01.06.2022	01.06.2021
	bis	30.11.2024	31.05.2024	31.05.2023	31.05.2022
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		874'808'414.98	856'978'918.69	935'420'884.97	798'338'876.55
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		874'808'414.98	856'978'918.69	935'420'884.97	798'338'876.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'696'438.687	8'985'041.915	10'170'117.029	8'624'346.202
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		100.5939	95.3784	91.9774	92.5680
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.2619	95.0637	92.2993	92.7532
Thesaurierung je Anteil		-	0.86	0.58	0.46
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %

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 GT CHF	5.79 %	7.33 %	-12.39 %	-1.80 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

### Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.11.2024	31.05.2024
Bankguthaben auf Sicht	9'100'000.00	2'500'000.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	870'180'921.50	851'914'465.00
Derivative Finanzinstrumente	-10'152'366.69	-2'296'839.73
Sonstige Vermögenswerte	6'961'554.15	6'431'240.78
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>876'090'108.96</b>	<b>858'548'866.05</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'144'023.93	-1'422'008.07
Andere Verbindlichkeiten	-137'670.05	-147'939.29
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>874'808'414.98</b>	<b>856'978'918.69</b>

### Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse GT CHF	von	01.06.2024	01.06.2023
	bis	30.11.2024	31.05.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'985'041.915	10'170'117.029
Ausgegebene Anteile		632'717.569	1'652'209.120
Zurückgenommene Anteile		-921'320.797	-2'837'284.234
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>8'696'438.687</b>	<b>8'985'041.915</b>

### Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von	01.06.2024	01.06.2023
	bis	30.11.2024	31.05.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		856'978'918.69	935'420'884.97
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'597'186.63	-2'004'846.27
Saldo aus dem Anteilverkehr		-27'384'310.95	-110'601'059.24
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		47'810'993.87	34'163'939.23
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>874'808'414.98</b>	<b>856'978'918.69</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.06.2024 30.11.2024</b>	<b>01.06.2023 31.05.2024</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		41'220.06	59'901.29
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		5'279'412.35	9'845'753.35
Erträge aus Wertpapierleihe		48'881.95	127'247.90
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		162'195.85	788'875.53
<b>Total Ertrag</b>		<b>5'531'710.21</b>	<b>10'821'778.07</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-84.65
Reglementarische Vergütungen		-848'581.27	-1'801'874.34
Sonstige Aufwendungen		-408.30	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-135'980.91	-1'284'806.76
<b>Total Aufwand</b>		<b>-984'970.48</b>	<b>-3'086'765.75</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>4'546'739.73</b>	<b>7'735'012.32</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'296'668.55	-14'381'272.13
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		241'916.20	866'891.22
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>2'491'987.38</b>	<b>-5'779'368.59</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		45'319'006.49	39'943'307.82
<b>Gesamterfolg</b>		<b>47'810'993.87</b>	<b>34'163'939.23</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>870'180'921.50</b>	<b>99.33</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>870'180'921.50</b>	<b>99.33</b>	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	5'000	0	0	5'000 CHF	185.50%	9'275'000.00	1.06	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	5'000	0	0	5'000 CHF	124.65%	6'232'500.00	0.71	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	2'000	0	1'000	1'000 CHF	108.07%	1'080'700.00	0.12	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	2'000	0	0	2'000 CHF	113.75%	2'275'000.00	0.26	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	500	0	0	500 CHF	111.73%	558'650.00	0.06	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132163434	2.8750 % KWLIL 2 7/8 06/30/31	1'370	0	0	1'370 CHF	111.20%	1'523'440.00	0.17	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	5'000	0	2'000	3'000 CHF	106.00%	3'180'000.00	0.36	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	2'500	0	0	2'500 CHF	104.80%	2'620'000.00	0.30	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	2'500	0	0	2'500 CHF	105.52%	2'638'000.00	0.30	a)
CH0212184037	6.2541 % ALPHSW FLOAT PERP	4'615	0	4'615	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	4'500	0	0	4'500 CHF	169.85%	7'643'250.00	0.87	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	3'500	0	0	3'500 CHF	108.75%	3'806'250.00	0.43	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.55%	995'500.00	0.11	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'000	0	0	2'000 CHF	100.00%	2'000'000.00	0.23	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	3'000	0	0	3'000 CHF	105.10%	3'153'000.00	0.36	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	5'000	0	0	5'000 CHF	100.45%	5'022'500.00	0.57	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	3'500	0	0	3'500 CHF	99.70%	3'489'500.00	0.40	a)
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	0	3'500	0	3'500 CHF	100.15%	3'505'250.00	0.40	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	11'500	0	0	11'500 CHF	98.23%	11'296'450.00	1.29	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	5'000	0	0	5'000 CHF	97.25%	4'862'500.00	0.56	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	2'500	0	1'000	1'500 CHF	98.80%	1'482'000.00	0.17	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	3'000	0	0	3'000 CHF	97.95%	2'938'500.00	0.34	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'570	0	570	1'000 CHF	97.45%	974'500.00	0.11	a)
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	3'000	0	0	3'000 CHF	106.80%	3'204'000.00	0.37	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	3'000	0	0	3'000 CHF	102.40%	3'072'000.00	0.35	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	4'000	0	0	4'000 CHF	98.05%	3'922'000.00	0.45	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	7'000	0	0	7'000 CHF	98.85%	6'919'500.00	0.79	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	3'000	0	0	3'000 CHF	99.53%	2'985'900.00	0.34	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	5'000	0	0	5'000 CHF	99.30%	4'965'000.00	0.57	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	2'000	0	0	2'000 CHF	99.86%	1'997'200.00	0.23	a)
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	3'000	0	0	3'000 CHF	102.00%	3'060'000.00	0.35	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	3'000	0	0	3'000 CHF	100.25%	3'007'500.00	0.34	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'500	0	0	1'500 CHF	102.10%	1'531'500.00	0.17	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	4'000	0	0	4'000 CHF	99.50%	3'980'000.00	0.45	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	5'000	0	0	5'000 CHF	100.43%	5'021'500.00	0.57	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'000	0	0	2'000 CHF	99.20%	1'984'000.00	0.23	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	2'000	0	0	2'000 CHF	98.95%	1'979'000.00	0.23	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	2'000	0	0	2'000 CHF	102.75%	2'055'000.00	0.23	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	99.35%	4'967'500.00	0.57	a)
CH0406990801	2.6250 % SLHNVX 2 5/8 09/25/48	2'435	0	0	2'435 CHF	104.55%	2'545'792.50	0.29	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	100.09%	1'000'900.00	0.11	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	6'000	0	0	6'000 CHF	99.51%	5'970'600.00	0.68	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	3'000	0	0	3'000 CHF	98.85%	2'965'500.00	0.34	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	3'000	0	0	3'000 CHF	98.27%	2'948'100.00	0.34	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'700	0	0	2'700 CHF	96.50%	2'605'500.00	0.30	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	3'000	0	0	3'000 CHF	86.30%	2'589'000.00	0.30	a)
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	0	1'000	0	1'000 CHF	81.35%	813'500.00	0.09	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'000	0	250	750 CHF	99.99%	749'925.00	0.09	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	5'000	4'000	0	9'000 CHF	97.75%	8'797'500.00	1.00	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	3'500	0	0	3'500 CHF	95.22%	3'332'700.00	0.38	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	2'600	0	0	2'600 CHF	98.85%	2'570'100.00	0.29	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	2'500	0	0	2'500 CHF	100.92%	2'523'000.00	0.29	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	5'000	0	0	5'000 CHF	95.00%	4'750'000.00	0.54	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	5'000	0	3'000	2'000 CHF	100.35%	2'007'000.00	0.23	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	5'000	0	0	5'000 CHF	98.13%	4'906'500.00	0.56	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.57%	995'700.00	0.11	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	3'500	0	0	3'500 CHF	82.60%	2'891'000.00	0.33	a)
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	5'000	0	0	5'000 CHF	97.25%	4'862'500.00	0.56	a)
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	96.45%	3'858'000.00	0.44	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	2'000	0	0	2'000 CHF	77.25%	1'545'000.00	0.18	a)
CH0505011889	0.2500 % BCI CI 0 1/4 10/29/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	99.51%	497'550.00	0.06	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	2'000	0	0	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.22	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	5'000	0	0	5'000 CHF	99.10%	4'955'000.00	0.57	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	5'000	0	0	5'000 CHF	94.55%	4'727'500.00	0.54	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	95.40%	7'155'000.00	0.82	a)
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 CHF	100.30%	4'012'000.00	0.46	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	5'000	0	4'000	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	0.11	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	7'000	0	1'000	6'000 CHF	114.05%	6'843'000.00	0.78	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	1'950	0	0	1'950 CHF	104.05%	2'028'975.00	0.23	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	5'000	0	3'000	2'000 CHF	98.30%	1'966'000.00	0.22	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	2'440	0	0	2'440 CHF	100.35%	2'448'540.00	0.28	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	8'000	0	1'000	7'000 CHF	98.05%	6'863'500.00	0.78	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	8'500	0	7'000	1'500 CHF	98.95%	1'484'250.00	0.17	a)
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	2'500	0	0	2'500 CHF	98.60%	2'465'000.00	0.28	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	2'000	0	0	2'000 CHF	97.80%	1'956'000.00	0.22	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.30%	1'966'000.00	0.22	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	1'000	0	0	1'000 CHF	90.75%	907'500.00	0.10	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'000	0	0	3'000 CHF	99.94%	2'998'200.00	0.34	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'000	0	0	5'000 CHF	97.31%	4'865'500.00	0.56	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557779011	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 10JU	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'000	0	1'000	4'000 CHF	97.55%	3'902'000.00	0.45	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	97.50%	1'462'500.00	0.17	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	2'500	0	0	2'500 CHF	95.85%	2'396'250.00	0.27	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	10'000	0	1'000	9'000 CHF	95.05%	8'554'500.00	0.98	a)
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 CHF	100.85%	4'034'000.00	0.46	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.65%	926'500.00	0.11	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	5'000	0	0	5'000 CHF	97.66%	4'883'000.00	0.56	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	10'000	0	0	10'000 CHF	86.87%	8'687'000.00	0.99	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	3'750	4'000	0	7'750 CHF	98.30%	7'618'250.00	0.87	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	5'000	0	0	5'000 CHF	96.83%	4'841'500.00	0.55	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	97.00%	7'760'000.00	0.89	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	1'250	0	0	1'250 CHF	94.50%	1'181'250.00	0.13	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	98.90%	2'571'400.00	0.29	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.20%	1'964'000.00	0.22	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'500	0	0	2'500 CHF	98.50%	2'462'500.00	0.28	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	1'000	0	0	1'000 CHF	92.50%	925'000.00	0.11	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	4'000	0	2'000	2'000 CHF	96.00%	1'920'000.00	0.22	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	5'000	0	3'755	1'245 CHF	97.15%	1'209'517.50	0.14	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	98.00%	3'920'000.00	0.45	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	4'000	0	2'000	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.22	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	3'000	0	0	3'000 CHF	95.72%	2'871'600.00	0.33	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	5'000	0	0	5'000 CHF	91.10%	4'555'000.00	0.52	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	1'800	0	0	1'800 CHF	96.50%	1'737'000.00	0.20	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'850	0	0	1'850 CHF	96.05%	1'776'925.00	0.20	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	1'500	0	0	1'500 CHF	95.45%	1'431'750.00	0.16	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	98.00%	1'568'000.00	0.18	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.45%	1'949'000.00	0.22	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.22	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	4'900	0	4'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	98.95%	4'947'500.00	0.56	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	500	0	0	500 CHF	98.70%	493'500.00	0.06	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.11	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	2'500	0	1'500	1'000 CHF	98.75%	987'500.00	0.11	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	96.60%	5'796'000.00	0.66	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'000	0	0	2'000 CHF	97.60%	1'952'000.00	0.22	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	4'000	0	0	4'000 CHF	99.80%	3'992'000.00	0.46	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	5'000	0	0	5'000 CHF	96.41%	4'820'500.00	0.55	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	5'000	0	0	5'000 CHF	100.30%	5'015'000.00	0.57	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	99.15%	5'949'000.00	0.68	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	10'000	0	5'000	5'000 CHF	101.72%	5'086'000.00	0.58	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	855	0	0	855 CHF	100.90%	862'695.00	0.10	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.50%	2'985'000.00	0.34	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'750	0	0	2'750 CHF	99.65%	2'740'375.00	0.31	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	5'000	0	0	5'000 CHF	102.26%	5'113'000.00	0.58	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.50%	3'045'000.00	0.35	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	2'500	0	0	2'500 CHF	103.45%	2'586'250.00	0.30	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	5'000	0	0	5'000 CHF	105.05%	5'252'500.00	0.60	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	5'000	0	3'000	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.23	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	2'000	0	0	2'000 CHF	100.19%	2'003'800.00	0.23	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	3'000	0	500	2'500 CHF	100.01%	2'500'250.00	0.29	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	5'000	0	0	5'000 CHF	104.50%	5'225'000.00	0.60	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	5'000	0	0	5'000 CHF	117.74%	5'887'000.00	0.67	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	10'000	0	0	10'000 CHF	111.20%	11'120'000.00	1.27	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	3'000	0	0	3'000 CHF	106.95%	3'208'500.00	0.37	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	5'000	0	0	5'000 CHF	102.30%	5'115'000.00	0.58	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	102.65%	2'053'000.00	0.23	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	5'000	0	0	5'000 CHF	111.12%	5'556'000.00	0.63	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	7'500	0	0	7'500 CHF	136.90%	10'267'500.00	1.17	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	102.65%	4'106'000.00	0.47	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	1'200	0	0	1'200 CHF	119.50%	1'434'000.00	0.16	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	5'000	0	0	5'000 CHF	103.70%	5'185'000.00	0.59	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	3'600	0	2'000	1'600 CHF	109.30%	1'748'800.00	0.20	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.55%	2'051'000.00	0.23	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	109.75%	2'195'000.00	0.25	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	3'500	0	0	3'500 CHF	108.50%	3'797'500.00	0.43	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	5'000	0	0	5'000 CHF	109.40%	5'470'000.00	0.62	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.85%	2'157'000.00	0.25	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	3'000	0	0	3'000 CHF	105.20%	3'156'000.00	0.36	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	105.60%	3'696'000.00	0.42	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	133.10%	6'655'000.00	0.76	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	3'000	0	0	3'000 CHF	148.50%	4'455'000.00	0.51	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	106.10%	3'183'000.00	0.36	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	3'000	0	250	2'750 CHF	101.99%	2'804'725.00	0.32	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	105.25%	2'105'000.00	0.24	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	105.80%	2'116'000.00	0.24	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	3'000	0	0	3'000 CHF	107.20%	3'216'000.00	0.37	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	2'200	0	0	2'200 CHF	106.75%	2'348'500.00	0.27	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	3'000	0	0	3'000 CHF	104.50%	3'135'000.00	0.36	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	2'000	0	0	2'000 CHF	106.70%	2'134'000.00	0.24	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'000	0	0	1'000 CHF	105.45%	1'054'500.00	0.12	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.25%	2'065'000.00	0.24	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	3'000	0	0	3'000 CHF	101.30%	3'039'000.00	0.35	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	3'000	0	1'600	1'400 CHF	106.90%	1'496'600.00	0.17	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.50%	2'150'000.00	0.25	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	3'000	0	0	3'000 CHF	107.10%	3'213'000.00	0.37	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	3'000	0	0	3'000 CHF	102.35%	3'070'500.00	0.35	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	3'000	0	0	3'000 CHF	104.60%	3'138'000.00	0.36	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	2'180	0	2'180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	2'000	0	0	2'000 CHF	111.25%	2'225'000.00	0.25	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	105.75%	3'172'500.00	0.36	a)
CH1266847172	2.4000 % KENOVA 2.4 07/19/38	2'250	0	100	2'150 CHF	116.75%	2'510'125.00	0.29	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	8'000	0	0	8'000 CHF	113.60%	9'088'000.00	1.04	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	2'000	0	2'000 CHF	113.80%	2'276'000.00	0.26	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	104.20%	3'126'000.00	0.36	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	108.65%	3'259'500.00	0.37	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	115.00%	3'450'000.00	0.39	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	106.80%	1'281'600.00	0.15	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	1'850	0	0	1'850 CHF	104.30%	1'929'550.00	0.22	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	3'000	0	500	2'500 CHF	103.80%	2'595'000.00	0.30	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	3'900	0	1'000	2'900 CHF	106.70%	3'094'300.00	0.35	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	910	0	910	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	106.70%	2'134'000.00	0.24	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	1'000	0	0	1'000 CHF	113.30%	1'133'000.00	0.13	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	108.85%	4'354'000.00	0.50	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSFC 2.7325 07/04/25 EMTN	2'000	0	1'000	1'000 CHF	101.10%	1'011'000.00	0.12	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	2'000	0	0	2'000 CHF	117.72%	2'354'400.00	0.27	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	2'000	0	0	2'000 CHF	101.13%	2'022'600.00	0.23	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	5'000	0	5'000 CHF	108.80%	5'440'000.00	0.62	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	5'000	0	0	5'000 CHF	112.13%	5'606'500.00	0.64	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	1'000	0	0	1'000 CHF	108.45%	1'084'500.00	0.12	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	1'000	0	300	700 CHF	104.35%	730'450.00	0.08	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	500	0	200	300 CHF	114.00%	342'000.00	0.04	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	106.60%	2'132'000.00	0.24	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	2'000	0	1'000	1'000 CHF	103.60%	1'036'000.00	0.12	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.10%	2'142'000.00	0.24	a)
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	2'000	0	0	2'000 CHF	138.80%	2'776'000.00	0.32	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	1'000	0	0	1'000 CHF	105.00%	1'050'000.00	0.12	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	2'000	0	0	2'000 CHF	108.20%	2'164'000.00	0.25	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	2'200	0	0	2'200 CHF	105.20%	2'314'400.00	0.26	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	102.40%	2'048'000.00	0.23	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	106.05%	2'121'000.00	0.24	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	2'090	0	0	2'090 CHF	107.65%	2'249'885.00	0.26	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	105.10%	3'153'000.00	0.36	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	108.30%	2'166'000.00	0.25	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	106.65%	1'919'700.00	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	2'250	0	0	2'250 CHF	104.65%	2'354'625.00	0.27	a)
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	1'500	0	0	1'500 CHF	101.95%	1'529'250.00	0.17	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	102.35%	3'070'500.00	0.35	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	105.95%	3'178'500.00	0.36	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	2'000	0	0	2'000 CHF	102.45%	2'049'000.00	0.23	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	2'000	3'000	0	5'000 CHF	102.90%	5'145'000.00	0.59	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	6'000	0	3'000	3'000 CHF	104.40%	3'132'000.00	0.36	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	105.75%	2'115'000.00	0.24	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	790	0	200	590 CHF	107.40%	633'660.00	0.07	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	3'000	0	1'500	1'500 CHF	107.35%	1'610'250.00	0.18	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	3'000	0	0	3'000 CHF	110.00%	3'300'000.00	0.38	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	2'000	0	0	2'000 CHF	105.00%	2'100'000.00	0.24	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	3'000	0	2'000	1'000 CHF	103.15%	1'031'500.00	0.12	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	2'250	0	0	2'250 CHF	109.65%	2'467'125.00	0.28	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	1'000	0	0	1'000 CHF	104.05%	1'040'500.00	0.12	a)
CH1305916772	1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33	1'000	0	0	1'000 CHF	108.50%	1'085'000.00	0.12	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	4'000	0	0	4'000 CHF	101.90%	4'076'000.00	0.47	a)
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	2'000	0	0	2'000 CHF	106.40%	2'128'000.00	0.24	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	1'000	0	0	1'000 CHF	108.53%	1'085'300.00	0.12	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1307121264	2.2500 % KWLILI 2 1/4 12/05/25	2'000	0	0	2'000 CHF	101.41%	2'028'200.00	0.23	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/05/29	1'000	0	0	1'000 CHF	107.00%	1'070'000.00	0.12	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	2'000	0	0	2'000 CHF	105.50%	2'110'000.00	0.24	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	1'000	0	0	1'000 CHF	103.75%	1'037'500.00	0.12	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	4'000	0	0	4'000 CHF	106.00%	4'240'000.00	0.48	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	10'000	0	10'000 CHF	108.05%	10'805'000.00	1.23	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	2'000	0	0	2'000 CHF	104.75%	2'095'000.00	0.24	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	2'000	0	0	2'000 CHF	108.10%	2'162'000.00	0.25	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	3'000	0	0	3'000 CHF	106.65%	3'199'500.00	0.37	a)
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	2'000	0	0	2'000 CHF	107.50%	2'150'000.00	0.25	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	107.75%	1'077'500.00	0.12	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.55%	2'071'000.00	0.24	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	3'000	0	0	3'000 CHF	107.25%	3'217'500.00	0.37	a)
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.80%	2'156'000.00	0.25	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	2'000	0	500	1'500 CHF	106.30%	1'594'500.00	0.18	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	1'000	1'000	0	2'000 CHF	104.25%	2'085'000.00	0.24	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	1'000	1'000	0	2'000 CHF	105.40%	2'108'000.00	0.24	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.95%	2'079'000.00	0.24	a)
CH1335850298	1.4778 % AFLBNK 1.4778 04/20/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	105.30%	1'053'000.00	0.12	a)
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	0	550	0	550 CHF	102.35%	562'925.00	0.06	a)
CH1335850348	1.6925 % BMETR 1.6925 10/30/31	0	1'000	0	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.12	a)
CH1336918763	2.2250 % AYVFP 2.225 03/28/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	103.20%	2'064'000.00	0.24	a)
CH1341034960	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/20/34 752	3'000	0	0	3'000 CHF	107.34%	3'220'200.00	0.37	a)
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	3'000	0	0	3'000 CHF	116.20%	3'486'000.00	0.40	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	4'500	0	0	4'500 CHF	106.60%	4'797'000.00	0.55	a)
CH1342551046	1.5500 % VALIAN 1.55 04/23/32	3'000	0	0	3'000 CHF	105.15%	3'154'500.00	0.36	a)
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1344316687	3.0000 % IMPNSW 3 05/17/28	3'000	0	1'000	2'000 CHF	103.90%	2'078'000.00	0.24	a)
CH1344316695	1.5225 % SLOVAK 1.5225 05/10/28 4Y	1'000	0	400	600 CHF	102.65%	615'900.00	0.07	a)
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34 10Y	3'000	0	0	3'000 CHF	107.45%	3'223'500.00	0.37	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	2'000	0	0	2'000 CHF	102.75%	2'055'000.00	0.23	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	2'000	0	0	2'000 CHF	107.45%	2'149'000.00	0.25	a)
CH1346742914	2.4000 % SGKNSW 2.4 05/30/34	2'900	0	0	2'900 CHF	108.85%	3'156'650.00	0.36	a)
CH1346742948	2.1500 % PGHNSW 2.15 06/07/34	5'000	0	250	4'750 CHF	108.70%	5'163'250.00	0.59	a)
CH1346743078	1.8500 % COOPSW 1.85 07/16/32	0	1'500	0	1'500 CHF	106.10%	1'591'500.00	0.18	a)
CH1348614061	2.4000 % BARY 2.4 05/17/34	3'000	0	0	3'000 CHF	107.75%	3'232'500.00	0.37	a)
CH1348614129	1.6500 % SIKASW 1.65 11/28/29	1'500	0	0	1'500 CHF	103.70%	1'555'500.00	0.18	a)
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	1'750	0	0	1'750 CHF	107.10%	1'874'250.00	0.21	a)
CH1349302906	1.3250 % BCJZSW 1.325 08/07/29	0	1'000	0	1'000 CHF	102.55%	1'025'500.00	0.12	a)
CH1350727793	1.8000 % SCMNIX 1.8 08/23/34	2'000	0	0	2'000 CHF	108.70%	2'174'000.00	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1350727801	2.0000 % SCMN VX 2 11/23/39	2'000	0	0	2'000 CHF	112.30%	2'246'000.00	0.26	a)
CH1353015014	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 JUL	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1353015030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 758	0	2'500	0	2'500 CHF	109.96%	2'749'000.00	0.31	a)
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	0	2'000	0	2'000 CHF	106.30%	2'126'000.00	0.24	a)
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	0	3'000	0	3'000 CHF	109.25%	3'277'500.00	0.37	a)
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	0	4'000	0	4'000 CHF	114.05%	4'562'000.00	0.52	a)
CH1353257871	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/13/27 755	0	2'000	0	2'000 CHF	102.58%	2'051'600.00	0.23	a)
CH1356197116	2.3500 % TRAGR 2.35 06/20/30 EMTN	1'725	0	0	1'725 CHF	104.80%	1'807'800.00	0.21	a)
CH1356570312	1.7425 % EDF 1.7425 09/06/32 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	103.05%	3'091'500.00	0.35	a)
CH1356570320	1.9875 % CMZB 1.9875 09/09/31	0	2'000	0	2'000 CHF	103.00%	2'060'000.00	0.24	a)
CH1357852800	2.0000 % ANNGR 2 08/26/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.80%	2'076'000.00	0.24	a)
CH1371736823	1.1700 % ROSW 1.17 09/06/39	0	2'000	0	2'000 CHF	104.15%	2'083'000.00	0.24	a)
CH1371736831	1.4875 % CCDJ 1.4875 09/11/29	0	2'000	0	2'000 CHF	102.55%	2'051'000.00	0.23	a)
CH1373904403	1.6000 % GALDSW 1.6 09/27/28	0	2'500	0	2'500 CHF	102.20%	2'555'000.00	0.29	a)
CH1373904411	1.9000 % GALDSW 1.9 09/27/32	0	2'500	100	2'400 CHF	104.10%	2'498'400.00	0.29	a)
CH1373904429	1.5000 % UNIZUE 1 1/2 09/27/32	0	500	0	500 CHF	102.85%	514'250.00	0.06	a)
CH1373904437	1.6500 % UNIZUE 1.65 09/26/36	0	500	0	500 CHF	103.55%	517'750.00	0.06	a)
CH1373904510	1.6000 % KWLILI 1.6 10/15/32	0	1'000	0	1'000 CHF	103.65%	1'036'500.00	0.12	a)
CH1376931536	1.2000 % BMW 1.2 10/09/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.35%	2'027'000.00	0.23	a)
CH1376931585	1.5225 % HTHROW 1.5225 12/03/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.60%	2'032'000.00	0.23	a)
CH1377443804	1.6500 % ZUGNSW 1.65 09/16/31	0	3'000	0	3'000 CHF	102.70%	3'081'000.00	0.35	a)
CH1377443812	2.1275 % ECLCI 2.1275 09/26/29	0	2'500	0	2'500 CHF	102.65%	2'566'250.00	0.29	a)
CH1377443853	1.6700 % ACAFP 1.67 09/26/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.90%	3'057'000.00	0.35	a)
CH1380011192	1.5000 % BKWSW 1 1/2 10/18/34	0	1'000	0	1'000 CHF	104.20%	1'042'000.00	0.12	a)
CH1380011291	1.3500 % EMMI 1.35 10/30/30	0	2'000	0	2'000 CHF	102.35%	2'047'000.00	0.23	a)
CH1380011309	1.6000 % EMMI 1.6 10/30/34	0	3'000	0	3'000 CHF	103.65%	3'109'500.00	0.35	a)
CH1380011374	1.7750 % PLANSW 1.775 11/27/29	0	1'500	0	1'500 CHF	101.10%	1'516'500.00	0.17	a)
CH1380508411	2.0725 % DB 2.0725 09/18/30 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	102.75%	1'233'000.00	0.14	a)
CH1380910211	1.7725 % SUNSW 1.7725 10/20/28	0	915	0	915 CHF	102.55%	938'332.50	0.11	a)
CH1380910245	1.5500 % KSBAAR 1.55 11/06/31	0	1'500	0	1'500 CHF	101.70%	1'525'500.00	0.17	a)
CH1380910302	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 OCT	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1380910328	1.3750 % ACLNSW 1 3/8 11/14/30	0	2'640	0	2'640 CHF	102.05%	2'694'120.00	0.31	a)
CH1390517030	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 07/24/47 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1392903592	1.6250 % AMALEA 1 5/8 12/18/28	0	3'000	0	3'000 CHF	100.75%	3'022'350.00	0.34	a)
CH1392903634	1.0700 % PFZENT 1.07 03/01/40 DEC	0	5'000	0	5'000 CHF	103.80%	5'190'000.00	0.59	a)
CH1396329752	1.1225 % TOYOTA 1.1225 05/22/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.60%	2'032'000.00	0.23	a)
CH1396329760	1.7400 % INSBER 1.74 11/27/34	0	3'500	0	3'500 CHF	102.05%	3'571'750.00	0.41	a)
CH1396329802	1.2500 % GEOFIS 1 1/4 12/10/27	0	2'000	0	2'000 CHF	100.56%	2'011'260.00	0.23	a)
CH1396329810	1.5500 % GEOFIS 1.55 12/11/31	0	2'550	0	2'550 CHF	101.81%	2'596'104.00	0.30	a)

**CHF** **870'180'921.50** **99.33**

**Derivative Finanzinstrumente** **-10'152'366.69** **-1.16**

**Swaps** **-10'152'366.69** **-1.16**

01/27	IRS FIX LEG 1.1075% P.A. CHF	50'000	0	0	50'000 CHF	101.85%	50'927'057.52	5.81	b)
01/27	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-50'000	0	0	-50'000 CHF	100.00	-50'000'000.00	-5.71	b)
01/27	IRS FIX LEG -0.1125% P.A. CHF	5'000	0	0	5'000 CHF	98.24%	4'912'119.40	0.56	b)
01/27	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-5'000	0	0	-5'000 CHF	100.00	-5'000'000.00	-0.57	b)
08/28	IRS FIX LEG 1.7725% P.A. CHF	10'000	0	0	10'000 CHF	106.28%	10'627'669.06	1.21	b)
08/28	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-10'000	0	0	-10'000 CHF	100.00	-10'000'000.00	-1.14	b)
01/31	IRS FIX LEG 1.1175% P.A. CHF	-13'000	8'000	0	-5'000 CHF	105.31%	-5'265'740.29	-0.60	b)
01/31	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	13'000	0	8'000	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.57	b)
07/33	IRS FIX LEG 1.7575% P.A. CHF	-15'000	0	0	-15'000 CHF	112.94%	-16'940'355.03	-1.93	b)
07/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	1.71	b)
01/34	IRS FIX LEG 1.2775% P.A. CHF	-10'000	0	0	-10'000 CHF	108.86%	-10'886'010.35	-1.24	b)
01/34	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	10'000	0	0	10'000 CHF	100.00	10'000'000.00	1.14	b)
07/34	IRS FIX LEG 1.005% P.A. CHF	0	0	8'000	-8'000 CHF	106.56%	-8'525'191.23	-0.97	b)
07/34	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	8'000	0	8'000 CHF	100.00	8'000'000.00	0.91	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.11.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
10/36	IRS FIX LEG 0.6725% P.A. CHF	0	0	10'000	-10'000 CHF	103.57%	-10'356'854.22	-1.18	b)
10/36	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	10'000	0	10'000 CHF	100.00	10'000'000.00	1.14	b)
10/38	IRS FIX LEG 1.682% P.A. CHF	-15'000	0	0	-15'000 CHF	117.75%	-17'661'762.23	-2.02	b)
10/38	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	0	15'000 CHF	100.00	15'000'000.00	1.71	b)
11/39	IRS FIX LEG 0.5658% P.A. CHF	0	0	5'000	-5'000 CHF	102.30%	-5'114'809.43	-0.58	b)
11/39	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	5'000	0	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.57	b)
04/42	IRS FIX LEG 1.6685% P.A. CHF	-10'000	10'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
04/42	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/45	IRS FIX LEG 1.8525% P.A. CHF	-10'000	0	0	-10'000 CHF	129.09%	-12'908'866.37	-1.47	b)
06/45	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	10'000	0	0	10'000 CHF	100.00	10'000'000.00	1.14	b)
12/48	IRS FIX LEG 1.185% P.A. CHF	-5'000	0	0	-5'000 CHF	118.10%	-5'905'185.16	-0.67	b)
12/48	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	5'000	0	0	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.57	b)
02/49	IRS FIX LEG 1.3% P.A. CHF	-5'000	0	0	-5'000 CHF	121.09%	-6'054'438.36	-0.69	b)
02/49	IRS FLOATING LEG - CHF - SONIO/N	5'000	0	0	5'000 CHF	100.00	5'000'000.00	0.57	b)

### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	9'100'000.00	1.04
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	870'180'921.50	99.33
Derivative Finanzinstrumente	-10'152'366.69	-1.16
Sonstige Vermögenswerte	6'961'554.15	0.79
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>876'090'108.96</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'144'023.93	
Andere Verbindlichkeiten	-137'670.05	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>874'808'414.98</b>	

### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	870'180'921.50	99.33
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-10'152'366.69	-1.16
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

### Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>116'525'402.50</b>	<b>13.30</b>
CH0009755197 4.0000 % SWISS 4 01/06/49	5'000 CHF 185.50%	9'275'000.00 1.06
CH0024524966 2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	5'000 CHF 124.65%	6'232'500.00 0.71
CH0031835561 3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	1'000 CHF 108.07%	1'080'700.00 0.12
CH0127181029 2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	2'000 CHF 113.75%	2'275'000.00 0.26
CH0127181193 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	500 CHF 111.73%	558'650.00 0.06
CH0199543569 1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000 CHF 106.00%	3'180'000.00 0.36
CH0224397007 2.0000 % SWISS 2 06/25/64	4'500 CHF 169.85%	7'643'250.00 0.87
CH0224397338 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	3'500 CHF 108.75%	3'806'250.00 0.43
CH0276423818 0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'000 CHF 100.00%	2'000'000.00 0.23
CH0307256450 0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	500 CHF 98.23%	491'150.00 0.06
CH0326213920 0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	2'500 CHF 97.95%	2'448'750.00 0.28
CH0344958472 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	3'000 CHF 106.80%	3'204'000.00 0.37
CH0344958688 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	3'000 CHF 102.40%	3'072'000.00 0.35
CH0352595893 0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	300 CHF 98.85%	296'550.00 0.03
CH0361532945 3.6000 % ZKB 3.6 PERP	3'000 CHF 102.00%	3'060'000.00 0.35
CH0392885809 0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	1'500 CHF 98.95%	1'484'250.00 0.17
CH0419041170 0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	3'000 CHF 98.27%	2'948'100.00 0.34
CH0419041337 0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	500 CHF 96.50%	482'500.00 0.06
CH0440081393 0.0000 % SWISS 0 06/26/34	9'000 CHF 97.75%	8'797'500.00 1.00
CH0440081401 0.0000 % SWISS 0 07/24/39	3'500 CHF 95.22%	3'332'700.00 0.38
CH0460054403 0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	2'000 CHF 98.85%	1'977'000.00 0.23
CH0485252875 0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	3'000 CHF 82.60%	2'478'000.00 0.28

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 30.11.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	1'100 CHF	97.25%	1'069'750.00	0.12
CH0485445990	0.1675 % NWDIE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'000 CHF	96.45%	964'500.00	0.11
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	2'000 CHF	77.25%	1'545'000.00	0.18
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	2'000 CHF	97.55%	1'951'000.00	0.22
CH0515152475	0.1600 % PPSNSW 0.16 09/16/31	100 CHF	94.55%	94'550.00	0.01
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	400 CHF	96.90%	387'600.00	0.04
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	2'440 CHF	100.35%	2'448'540.00	0.28
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	2'845 CHF	98.05%	2'789'522.50	0.32
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	500 CHF	98.95%	494'750.00	0.06
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	1'000 CHF	86.87%	868'700.00	0.10
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	400 CHF	98.90%	395'600.00	0.05
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	500 CHF	97.25%	486'250.00	0.06
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	400 CHF	98.95%	395'800.00	0.05
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'000 CHF	97.60%	1'952'000.00	0.22
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	4'500 CHF	101.72%	4'577'400.00	0.52
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	855 CHF	100.90%	862'695.00	0.10
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	550 CHF	117.74%	647'570.00	0.07
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'000 CHF	102.55%	2'051'000.00	0.23
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	500 CHF	109.40%	547'000.00	0.06
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	3'500 CHF	105.60%	3'696'000.00	0.42
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	1'000 CHF	133.10%	1'331'000.00	0.15
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	1'500 CHF	106.10%	1'591'500.00	0.18
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	1'200 CHF	106.70%	1'280'400.00	0.15
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'000 CHF	105.45%	1'054'500.00	0.12
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	500 CHF	107.10%	535'500.00	0.06
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	1'000 CHF	113.60%	1'136'000.00	0.13
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	300 CHF	114.00%	342'000.00	0.04
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	1'000 CHF	103.60%	1'036'000.00	0.12
CH1291601933	1.4625 % ACANXB 1.4625 03/25/27	500 CHF	101.95%	509'750.00	0.06
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	210 CHF	105.50%	221'550.00	0.03
CH1335850322	1.5575 % EQIX 1.5575 09/04/29 EMTN	550 CHF	102.35%	562'925.00	0.06
CH1341034986	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/24/54 754	1'500 CHF	116.20%	1'743'000.00	0.20
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	1'300 CHF	102.75%	1'335'750.00	0.15
CH1348614137	1.8750 % SIKASW 1 7/8 05/27/33	500 CHF	107.10%	535'500.00	0.06
CH1353257814	1.6500 % NOVNVX 1.65 06/18/31	500 CHF	106.30%	531'500.00	0.06
CH1353257822	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 06/16/34	500 CHF	109.25%	546'250.00	0.06
CH1353257830	1.8500 % NOVNVX 1.85 06/18/40	500 CHF	114.05%	570'250.00	0.07
CH1373904411	1.9000 % GALDSW 1.9 09/27/32	1'900 CHF	104.10%	1'977'900.00	0.23
CH1377443804	1.6500 % ZUGNSW 1.65 09/16/31	200 CHF	102.70%	205'400.00	0.02
CH1377443853	1.6700 % ACAFP 1.67 09/26/29 EMTN	600 CHF	101.90%	611'400.00	0.07
CH1380011309	1.6000 % EMMI 1.6 10/30/34	500 CHF	103.65%	518'250.00	0.06

## Collateral Accounts

OTC COLLATERAL SW-BFVVCHF CHF ZKB	9'100'000 CHF	9'100'000.00
-----------------------------------	---------------	--------------

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	6'659'409.25	5.304
Bond	CHF	118'861'017.94	94.661
Equity	CHF	44'334.74	0.035
Total	CHF	125'564'761.93	100.000

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

## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	166'086'058.65	18.985
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	59'674'202.24	6.821
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

## Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.06.2024 - 30.11.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
GT CHF	CHF	-	-	-	-

## 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	116'525'402.50
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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



## 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:** 01.06.2024 - 30.11.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
GT CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	4.000

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

## Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 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.

## Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 5 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (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 des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile der Teilvermögen führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 18 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zuflussenden 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 des Teilvermögens, getätigt wurden.