

SWISSCANTO (CH) BOND FUND CORPORATE

Jahresbericht per 31.01.2025

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 22. Mai 2025

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2025, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegeführten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen, dem Fondsvertrag sowie dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems des Anlagefonds abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Zugelassener Revisionsexperte

Beilagen

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2025, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Übersicht Klassen	4
4	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF	5
5	Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate	27
6	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF	48
7	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	66
8	Pflichtpublikationen	68

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 Corporate hedged CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Rechnungswährung: EUR

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

Rechnungswährung: CHF

Klasse	Valor	Währung
AT CHF	120551300	CHF
DT CHF	118413313	CHF
NT CHF	112379850	CHF

4 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

Übersicht

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'754'562'890.15	1'762'211'002.13	1'753'830'780.01
Klasse AA CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		165'119'528.37	198'396'067.67	231'948'271.41
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'017'035.879	2'381'202.042	2'745'263.380
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.8625	83.3176	84.4904
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.7642	83.2093	84.6509
Ausschüttung je Anteil		2.05	1.60	1.85
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BA CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'258'786.06	10'513'162.22	20'662'831.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		131'933.024	132'652.392	257'044.488
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.7575	79.2535	80.3862
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		77.6642	79.1504	80.5389
Ausschüttung je Anteil		2.25	1.95	2.10
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		49'495'419.36	56'299'296.50	62'455'732.59
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		552'991.962	628'032.278	699'815.137
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.5048	89.6440	89.2460
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.3974	89.5274	89.4156
Thesaurierung je Anteil		2.61	2.14	2.25
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DA CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'385'415.19	66'594'545.50	75'248'041.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		621'779.975	776'621.518	864'971.866
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.2507	85.7490	86.9948
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		84.1496	85.6376	87.1601
Ausschüttung je Anteil		2.55	2.10	2.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse DT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		41'070'506.18	42'649'012.18	46'945'573.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		452'388.173	469'252.595	519'061.794
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.7860	90.8871	90.4431
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		90.6770	90.7690	90.6150
Thesaurierung je Anteil		2.71	2.24	2.34
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse GT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		113'577'136.22	100'132'127.51	112'913'905.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'141'703.635	1'006'089.424	1'140'815.765
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.4804	99.5261	98.9765
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.3610	99.3967	99.1645
Thesaurierung je Anteil		3.07	2.54	2.66
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse MT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'312'625.39	4'792'936.00	7'495'994.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		48'367.517	53'867.517	84'932.517
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.1637	88.9764	88.2582
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.0567	88.8607	88.4259
Thesaurierung je Anteil		3.10	2.63	2.72
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse NT CHF	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'318'343'473.38	1'282'833'854.55	1'196'160'429.80
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	12'840'533.026	12'522'394.937	11'771'338.273
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	102.6705	102.4432	101.6164
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	102.5473	102.3100	101.8094
Thesaurierung je Anteil	3.57	3.00	3.14
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2024 / 2025	2023 / 2024	2022 / 2023
Klasse AA CHF	0.23 %	0.56 %	-11.29 %
Klasse BA CHF	0.65 %	0.99 %	-10.92 %
Klasse CT CHF	0.72 %	1.04 %	-10.87 %
Klasse DA CHF	0.77 %	1.44 %	-11.11 %
Klasse DT CHF	0.78 %	1.43 %	-11.11 %
Klasse GT CHF	0.88 %	1.54 %	-11.02 %
Klasse MT CHF	1.29 %	1.62 %	-10.36 %
Klasse NT CHF	1.28 %	1.94 %	-10.66 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2025	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	29'053'224.69	30'161'808.06
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'617'375'441.80	1'612'015'134.08
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	100'946'060.49	93'376'968.16
Derivative Finanzinstrumente	-12'609'695.32	8'035'074.97
Sonstige Vermögenswerte	20'053'229.54	18'930'518.30
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'754'818'261.20	1'762'519'503.57
Andere Verbindlichkeiten	-255'371.05	-308'501.44
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'754'562'890.15	1'762'211'002.13

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'381'202.042	2'745'263.380
Ausgegebene Anteile		62'545.326	89'957.103
Zurückgenommene Anteile		-426'711.489	-454'018.441
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'017'035.879	2'381'202.042
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		132'652.392	257'044.488
Ausgegebene Anteile		32'329.393	23'775.415
Zurückgenommene Anteile		-33'048.761	-148'167.511
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		131'933.024	132'652.392
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		628'032.278	699'815.137
Ausgegebene Anteile		13'807.073	35'430.604
Zurückgenommene Anteile		-88'847.389	-107'213.463
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		552'991.962	628'032.278
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		776'621.518	864'971.866
Ausgegebene Anteile		80'317.198	51'217.383
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		4'134.719	-
Zurückgenommene Anteile		-239'293.460	-139'567.731
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		621'779.975	776'621.518
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		469'252.595	519'061.794
Ausgegebene Anteile		22'723.209	22'407.120
Zurückgenommene Anteile		-39'587.631	-72'216.319
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		452'388.173	469'252.595
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'006'089.424	1'140'815.765
Ausgegebene Anteile		252'444.655	194'490.350
Zurückgenommene Anteile		-116'830.444	-329'216.691
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'141'703.635	1'006'089.424
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		53'867.517	84'932.517
Zurückgenommene Anteile		-5'500.000	-31'065.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		48'367.517	53'867.517
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'522'394.937	11'771'338.273
Ausgegebene Anteile		914'265.377	1'351'307.753
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		286'225.757	-
Zurückgenommene Anteile		-882'353.045	-600'251.089
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'840'533.026	12'522'394.937

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'762'211'002.13	1'753'830'780.01
Ausbezahlte Ausschüttung		-5'611'525.75	-7'416'429.81
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-14'895'430.39	-15'404'195.70
Saldo aus dem Anteilverkehr		-5'621'936.38	878'425.33
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		18'480'780.54	30'322'422.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'754'562'890.15	1'762'211'002.13

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		745'080.07	612'921.61
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-795.48	-1'743.64
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		58'105'852.52	48'254'471.30
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'649'800.04	2'759'557.07
Erträge aus Wertpapierleihe		304'327.95	368'868.75
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		299'687.45	0.00
Sonstige Erträge		0.06	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'955'492.41	2'448'339.98
Total Ertrag		64'059'445.02	54'442'415.07
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-3'184'436.90	-3'590'477.51
Sonstige Aufwendungen		-210.00	-504.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'675'382.87	-2'401'663.16
Total Aufwand		-5'860'029.77	-5'992'644.67
Nettoertrag / Verlust		58'199'415.25	48'449'770.40
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-157'587'291.00	-380'924.25
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		297'316.40	426'081.76
Realisierter Erfolg		-99'090'559.35	48'494'927.91
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		117'571'339.89	-18'172'505.61
Gesamterfolg		18'480'780.54	30'322'422.30

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	4'044'454.67	3'853'174.58
Vortrag des Vorjahres	96'861.44	53'610.13
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'141'316.11	3'906'784.71
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	4'134'923.55	3'809'923.27
Vortrag auf neue Rechnung	6'392.56	96'861.44
Total	4'141'316.11	3'906'784.71
Klasse BA CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	295'179.41	250'560.97
Vortrag des Vorjahres	4'025.75	12'136.94
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	299'205.16	262'697.91
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	296'849.30	258'672.16
Vortrag auf neue Rechnung	2'355.86	4'025.75
Total	299'205.16	262'697.91
Klasse CT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	1'447'669.20	1'347'318.28
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'447'669.20	1'347'318.28
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	506'684.22	471'561.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	940'984.98	875'756.88
Total	1'447'669.20	1'347'318.28
Klasse DA CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	1'569'511.79	1'645'462.92
Vortrag des Vorjahres	25'936.53	11'378.80
Vortrag des Vorjahres aus übernommenen Fonds	104.00	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'595'552.32	1'656'841.72
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'585'538.94	1'630'905.19
Vortrag auf neue Rechnung	10'013.38	25'936.53
Total	1'595'552.32	1'656'841.72
Klasse DT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	1'229'590.96	1'051'437.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'229'590.96	1'051'437.52
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	430'356.84	368'003.13
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	799'234.12	683'434.39
Total	1'229'590.96	1'051'437.52
Klasse GT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	3'512'187.59	2'564'961.80
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'512'187.59	2'564'961.80
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'229'265.66	897'736.63
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'282'921.93	1'667'225.17
Total	3'512'187.59	2'564'961.80
Klasse MT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	150'315.91	141'965.15
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	150'315.91	141'965.15
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	52'610.57	49'687.80
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	97'705.34	92'277.35
Total	150'315.91	141'965.15
Klasse NT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	45'950'505.72	37'594'889.18
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	45'950'505.72	37'594'889.18
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	16'082'677.00	13'158'211.21
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	29'867'828.72	24'436'677.97
Total	45'950'505.72	37'594'889.18

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'617'375'441.80	92.17	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'617'375'441.80	92.17	
AU3CB0243764	4.0000 % TLSAU 4 04/19/27 MTN	11'000	0	0	11'000 AUD	98.98%	6'166'933.04	0.35 a)	
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	5'550	0	5'550	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0291284	6.3220 % NAB 6.322 08/03/32 MTN	0	6'000	0	6'000 AUD	103.18%	3'506'581.47	0.20 a)	
AU3CB0293769	6.8600 % CBAAU 6.86 11/09/32 MTN	0	5'000	0	5'000 AUD	104.85%	2'969'190.43	0.17 a)	
AUD							12'642'704.94	0.72	
CA00206RDY59	4.8500 % T 4.85 05/25/47 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	96.98%	1'216'150.59	0.07 a)	
CA06368LB887	4.5370 % BMO 4.537 12/18/28	2'000	0	0	2'000 CAD	103.74%	1'300'933.28	0.07 a)	
CA064151S959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	10'000	0	5'000	5'000 CAD	99.87%	3'130'915.01	0.18 a)	
CA06415FRB09	3.7000 % BNS 3.7 07/27/2081 1	0	5'000	0	5'000 CAD	91.10%	2'855'945.00	0.16 a)	
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	3'000	1'000	0	4'000 CAD	76.15%	1'909'786.05	0.11 a)	
CA07813ZCE21	2.5000 % BCECN 2 1/2 05/14/30 MTN	4'000	1'000	0	5'000 CAD	93.78%	2'939'962.74	0.17 a)	
CA29251ZBU09	3.1000 % ENBCN 3.1 09/21/33 MTN	10'000	0	0	10'000 CAD	92.49%	5'799'168.13	0.33 a)	
CA31430WU444	5.2790 % CCDJ 5.279 05/15/34	0	5'000	0	5'000 CAD	105.08%	3'294'279.37	0.19 a)	
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	5'000	0	0	5'000 CAD	96.39%	3'021'660.59	0.17 a)	
CA775109BJ98	3.2500 % RCICN 3 1/4 05/01/29	5'000	0	0	5'000 CAD	98.19%	3'078'247.17	0.18 a)	
CA780086TQ70	3.6500 % RY 3.65 11/24/2081	0	5'000	0	5'000 CAD	90.81%	2'846'884.87	0.16 a)	
CA780086WK63	5.0100 % RY 5.01 02/01/33	11'000	0	3'000	8'000 CAD	103.78%	5'205'388.39	0.30 a)	
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	9'000	0	0	9'000 CAD	95.98%	5'416'304.28	0.31 a)	
CA89117FM630	3.6000 % TD 3.6 10/31/2081 1	0	6'000	0	6'000 CAD	90.62%	3'409'001.21	0.19 a)	
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	13'000	0	5'000	8'000 CAD	99.15%	4'973'348.93	0.28 a)	
CAD							50'397'975.61	2.87	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	6'500	0	0	6'500 CHF	101.25%	6'581'250.00	0.38 a)	
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	4'000	0	0	4'000 CHF	100.40%	4'016'000.00	0.23 a)	
CHF							10'597'250.00	0.60	
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0390158245	4.7500 % PROXBB 4 3/4 PERP	0	4'200	0	4'200 EUR	100.03%	3'965'815.27	0.23 a)	
BE6317598850	3.8750 % AGSBB 3 7/8 PERP	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	3'000	0	0	3'000 EUR	89.06%	2'522'178.61	0.14 a)	
BE6350791073	3.8750 % SOLBBB 3 7/8 04/03/28	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6355213644	3.2500 % LONNVX 3 1/4 09/04/30	0	5'200	5'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	6'000	2'000	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	93.41%	4'408'896.85	0.25 a)	
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	8'000	0	0	8'000 EUR	86.72%	6'549'023.29	0.37 a)	
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	111.62%	2'107'257.48	0.12 a)	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	4'900	0	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A383QR0	3.8500 % AMPRIO 3.85 08/27/39 EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	101.04%	2'098'286.01	0.12 a)	
DE000A383S52	7.3750 % DB 7 3/8 PERP	0	4'000	0	4'000 EUR	103.90%	3'923'017.65	0.22 a)	
DE000A3L69X8	3.3750 % TRAGR 3 3/8 01/14/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	100.33%	3'788'370.06	0.22 a)	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	107.40%	2'534'601.22	0.14 a)	
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	97.25%	3'672'035.44	0.21 a)	
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	7'000	0	2'000	5'000 EUR	100.76%	4'755'474.69	0.27 a)	
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	8'000	0	2'000	6'000 EUR	105.27%	5'962'120.64	0.34 a)	
FR0013331949	3.1250 % FRPTT 3 1/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	5'100	0	0	5'100 EUR	89.34%	4'300'894.64	0.25 a)	
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140046Y4	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 PERP	4'500	0	0	4'500 EUR	87.58%	3'720'187.25	0.21 a)	
FR0014006KD4	1.1250 % BFCM 1 1/8 11/19/31 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	84.78%	4'001'669.06	0.23 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	4'600	0	0	4'600 EUR	91.64%	3'979'240.38	0.23	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	105.85%	4'396'353.40	0.25	a)
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	106.34%	2'108'032.48	0.12	a)
FR001400KCC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	107.13%	2'224'696.54	0.13	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	105.22%	5'959'571.93	0.34	a)
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400OX54	4.5000 % ORAFP 4 1/2 PERP	0	3'700	0	3'700 EUR	102.53%	3'581'151.15	0.20	a)
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	0	1'700	0	1'700 EUR	105.02%	1'685'287.75	0.10	a)
FR001400SMS8	5.1250 % EDF 5 1/8 PERP EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	102.14%	2'121'233.87	0.12	a)
FR001400T9Q9	3.2500 % BFCM 3 1/4 10/17/31 EMTN	0	4'900	0	4'900 EUR	100.14%	4'632'103.74	0.26	a)
FR001400U3Q9	5.4940 % ROQFRE 5.494 PERP	0	4'900	0	4'900 EUR	101.50%	4'694'824.75	0.27	a)
FR001400WKPO	4.2500 % BPCEGP 4 1/4 07/16/35 EMTN	0	900	0	900 EUR	101.91%	865'814.98	0.05	a)
FR001400WRE9	4.2500 % RCFFP 4 1/4 01/21/30 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	100.41%	1'706'074.86	0.10	a)
IT0005631822	3.3000 % UCGIM 3.3 07/16/29 EMTN	0	4'900	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTEDP40M0025	5.9430 % EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1548475968	7.7500 % ISPIM 7 3/4 PERP	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1693822634	4.7500 % ABNAV 4 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	99.49%	3'756'766.01	0.21	a)
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	99.38%	3'752'423.76	0.21	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	5'000	0	0	5'000 EUR	96.75%	4'566'350.71	0.26	a)
XS1793250041	4.7500 % SANTAN 4 3/4 PERP	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877860533	4.6250 % RABOBK 4 5/8 PERP	6'000	0	4'000	2'000 EUR	100.52%	1'897'696.59	0.11	a)
XS2010028343	2.8750 % SESGFP 2 7/8 PERP	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2022424993	1.7500 % ISPIM 1 3/4 07/04/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050933972	3.2500 % RABOBK 3 1/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	97.64%	4'608'404.48	0.26	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	8'000	0	4'000	4'000 EUR	90.32%	3'410'443.04	0.19	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	89.72%	4'234'451.56	0.24	a)
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	3'800	0	800	3'000 EUR	90.84%	2'572'388.26	0.15	a)
XS2102912966	4.3750 % SANTAN 4 3/8 PERP	1'000	0	0	1'000 EUR	99.76%	941'683.58	0.05	a)
XS2109819859	2.5020 % TELEFO 2.502 PERP	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2131567138	4.3750 % ABNAV 4 3/8 PERP	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182055009	3.7500 % DSFIR 3 3/4 PERP	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	101.26%	3'823'296.87	0.22	a)
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	95.26%	2'697'586.74	0.15	a)
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	6'150	1'000	0	7'150 EUR	98.63%	6'656'837.18	0.38	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	6'000	0	0	6'000 EUR	93.11%	5'273'514.88	0.30	a)
XS2201857534	2.4290 % ASSGEN 2.429 07/14/31 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	5'000	4'000	0	9'000 EUR	99.90%	8'486'961.24	0.48	a)
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	91.01%	5'154'461.64	0.29	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	4'300	0	4'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2286041947	3.0000 % HBRLN 3 PERP NC8	0	4'500	0	4'500 EUR	94.28%	4'004'878.55	0.23	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2290960876	2.1250 % TTEFP 2 1/8 PERP NC12	0	3'000	0	3'000 EUR	86.98%	2'463'246.69	0.14	a)
XS2308313860	1.6250 % ANVAU 1 5/8 03/11/2081 EMTN	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2312746345	1.8750 % ENELIM 1 7/8 PERP 95Y	0	2'000	0	2'000 EUR	88.40%	1'668'992.03	0.10	a)
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	87.71%	4'139'771.58	0.24	a)
XS2332245377	3.1000 % RABOBK 3.1 PERP	0	2'000	0	2'000 EUR	93.49%	1'765'012.45	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	4'500	0	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 EUR	94.99%	2'689'997.23	0.15	a)
X52353073161	2.6250 % POSIM 2 5/8 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	91.30%	6'032'767.20	0.34	a)
X52360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	4'400	0	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	7'000	0	1'000	6'000 EUR	88.47%	5'010'997.38	0.29	a)
X52381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	8'000	0	1'000	7'000 EUR	83.76%	5'534'805.22	0.32	a)
X52388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	3'400	0	1'000	2'400 EUR	91.35%	2'069'555.40	0.12	a)
X52388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	91.14%	1'720'570.44	0.10	a)
X52405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	1'300	1'500	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52410367747	2.8800 % TELEFO 2.88 PERP	3'100	0	0	3'100 EUR	96.88%	2'835'087.94	0.16	a)
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	7'500	0	5'000	2'500 EUR	84.32%	1'989'813.70	0.11	a)
X52434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	2'200	1'000	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	3'500	0	0	3'500 EUR	84.77%	2'800'672.76	0.16	a)
X52462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	600	3'000	0	3'600 EUR	110.27%	3'747'186.62	0.21	a)
X52464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	6'800	0	2'800	4'000 EUR	94.21%	3'557'362.21	0.20	a)
X52526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	7'000	0	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	5'600	0	5'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	107.09%	2'830'374.71	0.16	a)
X52549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	3'700	0	0	3'700 EUR	114.17%	3'987'524.64	0.23	a)
X52554581830	7.0000 % ASRNED 7 12/07/43	2'000	0	0	2'000 EUR	119.08%	2'248'191.90	0.13	a)
X52560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	103.68%	4'893'624.41	0.28	a)
X52561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	8'000	0	8'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	4'800	0	0	4'800 EUR	107.63%	4'876'719.83	0.28	a)
X52592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	5'350	0	5'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	2'500	0	0	2'500 EUR	104.89%	2'475'272.84	0.14	a)
X52598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	3'800	0	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52602037629	6.3750 % NNGRNV 6 3/8 PERP	0	7'000	0	7'000 EUR	105.01%	6'938'495.04	0.40	a)
X52626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	6'800	0	1'800	5'000 EUR	106.54%	5'028'281.44	0.29	a)
X52629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	105.80%	3'994'721.46	0.23	a)
X52636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	107.14%	4'045'393.66	0.23	a)
X52644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	3'000	0	0	3'000 EUR	106.84%	3'025'521.21	0.17	a)
X52646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	4'300	0	0	4'300 EUR	111.75%	4'536'002.14	0.26	a)
X52673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	2'900	0	1'000	1'900 EUR	104.15%	1'868'042.78	0.11	a)
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	3'800	0	0	3'800 EUR	107.61%	3'860'162.60	0.22	a)
X52694995163	3.6250 % ASRNED 3 5/8 12/12/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52708134023	7.8620 % VARNO 7.862 11/15/2083	5'000	0	0	5'000 EUR	110.04%	5'193'711.83	0.30	a)
X52711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	109.93%	1'556'598.48	0.09	a)
X52715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	8'300	0	0	8'300 EUR	107.44%	8'417'618.29	0.48	a)
X52726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	4'300	0	0	4'300 EUR	108.16%	4'390'160.03	0.25	a)
X52728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	5'450	0	5'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52731506841	3.7500 % MET 3 3/4 12/07/31 GMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	4'100	0	0	4'100 EUR	107.26%	4'151'134.12	0.24	a)
X52747610751	3.8750 % ABNANV 3 7/8 01/15/32 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	103.22%	2'923'006.29	0.17	a)
X52750308483	4.7500 % ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	5'300	0	1'300	4'000 EUR	105.09%	3'968'214.84	0.23	a)
X52751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	2'000	0	0	2'000 EUR	105.00%	1'982'332.76	0.11	a)
X52764455619	3.8750 % KPN 3 7/8 02/16/36 GMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52770512064	4.7500 % ENELIM 4 3/4 PERP	0	7'400	0	7'400 EUR	102.39%	7'152'313.23	0.41	a)
X52774944008	6.8750 % ABNANV 6 7/8 PERP	0	5'000	0	5'000 EUR	107.75%	5'085'627.49	0.29	a)
X52776511730	3.6250 % BKNG 3 5/8 03/01/32	0	4'400	0	4'400 EUR	102.53%	4'258'624.70	0.24	a)
X52778385240	5.1250 % ORSTED 5 1/8 03/14/3024	0	4'000	0	4'000 EUR	101.66%	3'838'475.88	0.22	a)
X52779901482	4.1250 % AALLN 4 1/8 03/15/32	0	3'200	0	3'200 EUR	103.18%	3'116'876.55	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2782109016	4.2500 % SABSM 4 1/4 09/13/30 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2794589403	5.1250 % BRITEL 5 1/8 10/03/54 EMTN	0	3'400	0	3'400 EUR	103.51%	3'322'208.46	0.19	a)
XS2798269069	4.7500 % TRNIM 4 3/4 PERP	0	8'100	0	8'100 EUR	102.97%	7'873'154.55	0.45	a)
XS2824778075	4.8750 % KPN 4 7/8 PERP	0	3'900	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	2'500	0	2'500 EUR	103.41%	2'440'393.22	0.14	a)
XS2830327446	5.0000 % AEMSPA 5 PERP	0	2'250	0	2'250 EUR	103.02%	2'188'113.06	0.12	a)
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	900	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2872909770	3.2780 % AZN 3.278 08/05/33 EMTN	0	4'500	0	4'500 EUR	100.70%	4'277'590.90	0.24	a)
XS2879811987	3.8750 % MRKGR 3 7/8 08/27/54	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2886191589	4.2500 % INTNED 4 1/4 08/26/35 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	102.27%	2'896'273.12	0.17	a)
XS2892944732	3.3750 % SYK 3 3/8 09/11/32	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2895631567	3.1250 % EOANGR 3 1/8 03/05/30 EMTN	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2896350175	4.5000 % SRGIM 4 1/2 PERP	0	7'300	0	7'300 EUR	101.82%	7'016'106.20	0.40	a)
XS2898762864	5.5000 % SESGFP 5 1/2 09/12/54	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2904504979	4.0000 % EUROB 4 09/24/30 EMTN	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2911681083	3.0000 % WURTH 3 08/28/31	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2932834604	3.2500 % DSVDC 3 1/4 11/06/30 EMTN	0	3'350	0	3'350 EUR	100.71%	3'184'808.26	0.18	a)
XS2937308497	4.1200 % TTEFP 4.12 PERP	0	6'650	0	6'650 EUR	101.24%	6'355'101.12	0.36	a)
XS2945618465	3.2500 % BKNG 3 1/4 11/21/32	0	2'200	0	2'200 EUR	99.87%	2'073'967.51	0.12	a)
XS2948435743	3.6250 % PRYIM 3 5/8 11/28/28 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2949317676	4.2470 % IBESM 4.247 PERP EMTN	0	5'200	0	5'200 EUR	101.14%	4'964'690.09	0.28	a)
XS2959514519	6.0000 % AIB 6 PERP	0	3'100	0	3'100 EUR	100.51%	2'941'283.40	0.17	a)
XS2963891028	4.5000 % ENIIM 4 1/2 PERP EMTN	0	6'050	0	6'050 EUR	100.75%	5'753'838.83	0.33	a)
XS2969695084	3.2500 % FERSM 3 1/4 01/16/30	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2971648725	4.0830 % ASSGEN 4.083 07/16/35 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	102.33%	4'829'576.18	0.28	a)
EUR							380'888'325.98	21.71	
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	95.80%	3'242'625.55	0.18	a)
XS0452187320	5.7500 % ENELIM 5 3/4 09/14/40 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	98.51%	1'667'228.85	0.10	a)
XS0730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	95.96%	2'165'428.62	0.12	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	5'000	0	0	5'000 GBP	80.97%	4'567'630.48	0.26	a)
XS1242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	97.41%	2'198'149.25	0.13	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 GBP	96.90%	8'746'833.24	0.50	a)
XS1492680902	2.1250 % CDTFIN 2 1/8 09/22/28 EMTN	2'000	0	500	1'500 GBP	91.68%	1'551'668.61	0.09	a)
XS1492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	3'500	0	0	3'500 GBP	69.87%	2'758'997.74	0.16	a)
XS1891174424	3.7500 % DLR 3 3/4 10/17/30	2'500	0	1'000	1'500 GBP	93.21%	1'577'512.27	0.09	a)
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	5'000	0	0	5'000 GBP	72.38%	4'083'308.76	0.23	a)
XS2195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	5'600	0	0	5'600 GBP	104.73%	6'617'392.80	0.38	a)
XS2636324274	8.3750 % BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	106.79%	3'614'828.34	0.21	a)
XS2685873908	6.8000 % HSBC 6.8 09/14/31	3'500	0	0	3'500 GBP	107.35%	4'239'177.42	0.24	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	4'000	0	0	4'000 GBP	104.64%	4'722'511.88	0.27	a)
XS2892335394	5.6250 % BRITEL 5 5/8 12/03/41 EMTN	0	2'500	0	2'500 GBP	96.08%	2'710'255.29	0.15	a)
GBP							54'463'549.10	3.10	
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	360'000	0	0	360'000 JPY	99.55%	2'101'519.60	0.12	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	360'000	0	0	360'000 JPY	98.27%	2'074'603.57	0.12	a)
XS1702964351	2.1080 % AFL 2.108 10/23/47	200'000	0	0	200'000 JPY	99.85%	1'171'041.05	0.07	a)
JPY							5'347'164.22	0.30	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	5'000	300	0	5'300 USD	94.86%	4'565'149.64	0.26	a)
CH0286864027	6.8750 % UBS 6 7/8 PERP	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002RQ0	4.8750 % CNFPF 4 7/8 PERP	0	5'000	0	5'000 USD	88.35%	4'011'083.86	0.23	a)
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	3'000	0	0	3'000 USD	94.18%	2'565'468.26	0.15	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	10'000	0	0	10'000 USD	67.54%	6'132'878.90	0.35	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	3'540	0	0	3'540 USD	67.01%	2'153'938.00	0.12	a)
US00206RMM15	2.5500 % T 2.55 12/01/33	0	467	0	467 USD	80.64%	341'952.98	0.02	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	95.14%	8'638'733.68	0.49	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YAR09	4.5000 % ABBV 4 1/2 05/14/35	0	5'000	0	5'000 USD	94.04%	4'269'741.91	0.24	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	10'000	300	5'300	5'000 USD	93.22%	4'232'511.86	0.24	a)
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MAX39	3.3000 % AER 3.3 01/30/32	4'000	200	0	4'200 USD	87.58%	3'339'944.11	0.19	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	1'000	150	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MBK09	6.9500 % AER 6.95 03/10/55	0	1'500	0	1'500 USD	102.45%	1'395'377.73	0.08	a)
US00774MBP95	5.3750 % AER 5 3/8 12/15/31	0	2'650	0	2'650 USD	99.72%	2'399'522.58	0.14	a)
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	3'100	150	0	3'250 USD	99.13%	2'925'546.41	0.17	a)
US018820AD21	5.6000 % ALVGR 5.6 09/03/54 144A	0	1'000	0	1'000 USD	98.72%	896'463.28	0.05	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	20'000	0	0	20'000 USD	72.26%	13'123'138.60	0.75	a)
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	10'000	0	0	10'000 USD	81.98%	7'443'921.49	0.42	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	10'000	0	0	10'000 USD	73.38%	6'663'180.10	0.38	a)
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	4'600	0	0	4'600 USD	95.10%	3'972'439.07	0.23	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	1'450	100	0	1'550 USD	103.10%	1'451'081.15	0.08	a)
US03027XAP50	3.5500 % AMT 3.55 07/15/27	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	5'110	0	0	5'110 USD	72.08%	3'344'470.46	0.19	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	2'500	250	0	2'750 USD	90.38%	2'256'912.87	0.13	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	83.97%	3'812'311.72	0.22	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	3'400	0	0	3'400 USD	90.82%	2'804'042.06	0.16	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	7'000	0	0	7'000 USD	95.41%	6'064'466.41	0.35	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	5'019	0	0	5'019 USD	83.94%	3'825'431.25	0.22	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	12'000	0	0	12'000 USD	69.84%	7'610'185.44	0.43	a)
US031162DD92	3.0000 % AMGN 3 02/22/29	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	5'000	0	0	5'000 USD	96.68%	4'389'468.30	0.25	a)
US034863AX89	2.6250 % AALLN 2 5/8 09/10/30 144A	5'000	0	0	5'000 USD	87.06%	3'952'650.85	0.23	a)
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	12'000	0	0	12'000 USD	99.74%	10'868'486.77	0.62	a)
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	97.32%	4'418'435.09	0.25	a)
US036752BB83	4.7500 % ELV 4 3/4 02/15/30	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000	0	0	15'000 USD	76.59%	10'432'132.43	0.59	a)
US037833EB24	0.7000 % AAPL 0.7 02/08/26	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	4'000	200	4'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	2'500	0	0	2'500 USD	58.60%	1'330'384.06	0.08	a)
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	5'000	0	0	5'000 USD	100.50%	4'562'905.85	0.26	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	90.89%	4'126'769.43	0.24	a)
US052769AH94	2.4000 % ADSK 2.4 12/15/31	2'615	0	0	2'615 USD	84.48%	2'006'091.71	0.11	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565QDV77	4.8750 % BPLN 4 7/8 PERP	0	2'000	0	2'000 USD	96.19%	1'746'815.79	0.10	a)
US05565QDW50	6.4500 % BPLN 6.45 PERP	0	1'800	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565QDX34	6.1250 % BPLN 6 1/8 PERP	0	3'100	0	3'100 USD	98.65%	2'776'868.66	0.16	a)
US058498AW66	2.8750 % BALL 2 7/8 08/15/30	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	4'000	0	4'000 USD	101.14%	3'673'570.76	0.21	a)
US05964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	4'000	0	4'000 USD	100.81%	3'661'693.46	0.21	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	5'000	400	0	5'400 USD	85.68%	4'201'391.17	0.24	a)
US06051GGC78	4.1830 % BAC 4.183 11/25/27 L	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	10'000	0	0	10'000 USD	95.99%	8'715'917.93	0.50	a)
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	10'000	0	0	10'000 USD	82.26%	7'469'165.28	0.43	a)
US06051GHX07	2.8840 % BAC 2.884 10/22/30 MTN	4'000	500	0	4'500 USD	90.93%	3'715'604.39	0.21	a)
US06051GIW06	3.3110 % BAC 3.311 04/22/42	7'000	0	0	7'000 USD	75.17%	4'778'131.86	0.27	a)
US06368EDC30	0.9490 % BMO 0.949 01/22/27 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	96.37%	4'375'302.72	0.25	a)
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	7'500	0	2'500	5'000 USD	99.31%	4'509'058.48	0.26	a)
US06407FZE11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	7'750	300	5'000	3'050 USD	95.55%	2'646'196.63	0.15	a)
US06407FZF85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	8'000	0	0	8'000 USD	86.29%	6'268'741.34	0.36	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	6'000	0	0	6'000 USD	84.03%	4'577'988.56	0.26	a)
US06675FAZ09	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 144A	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738ECN31	9.6250 % BACR 9 5/8 PERP	2'200	0	0	2'200 USD	110.91%	2'215'640.18	0.13	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	6'000	200	0	6'200 USD	90.75%	5'108'974.43	0.29	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	5'000	3'000	0	8'000 USD	86.28%	6'267'579.03	0.36	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	5'000	125	0	5'125 USD	83.88%	3'903'756.89	0.22	a)
US0778PFAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	6'000	0	0	6'000 USD	68.87%	3'752'298.69	0.21	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	87.07%	1'581'296.43	0.09	a)
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	95.98%	4'357'822.76	0.25	a)
US09660V2B87	2.5880 % BNP 2.588 08/12/35 REGS	0	400	0	400 USD	84.57%	307'186.05	0.02	a)
US110122CP17	3.4000 % BMV 3.4 07/26/29	5'000	0	0	5'000 USD	94.51%	4'291'171.89	0.24	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	5'000	0	0	5'000 USD	73.40%	3'332'361.89	0.19	a)
US11135FBT75	4.1500 % AVGO 4.15 04/15/32 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	10'000	0	0	10'000 USD	83.72%	7'602'557.82	0.43	a)
US126650DM98	1.3000 % CVS 1.3 08/21/27	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	2'250	0	0	2'250 USD	81.42%	1'663'440.90	0.09	a)
US126650EH94	7.0000 % CVS 7 03/10/55	0	4'170	0	4'170 USD	101.06%	3'826'516.80	0.22	a)
US12704PAA66	5.2000 % CRHID 5.2 05/21/29	0	10'000	2'000	8'000 USD	100.68%	7'313'579.99	0.42	a)
US134429BQ17	4.7500 % CPB 4 3/4 03/23/35	0	1'700	0	1'700 USD	94.32%	1'456'050.00	0.08	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'600	0	0	2'600 USD	83.85%	1'979'734.24	0.11	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	6'000	0	0	6'000 USD	90.54%	4'932'672.89	0.28	a)
US161175BX17	2.3000 % CHTR 2.3 02/01/32	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175CC60	4.4000 % CHTR 4.4 12/01/61	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33 144A	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33	0	6'250	0	6'250 USD	102.21%	5'800'453.14	0.33	a)
US172967HB08	5.5000 % C 5 1/2 09/13/25	6'000	0	2'000	4'000 USD	100.36%	3'645'348.56	0.21	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	6'000	0	0	6'000 USD	95.84%	5'221'814.17	0.30	a)
US17325FBK30	4.8380 % C 4.838 08/06/29	0	4'325	0	4'325 USD	100.08%	3'930'261.74	0.22	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	3'700	400	0	4'100 USD	86.49%	3'220'138.71	0.18	a)
US191216DC18	2.5000 % KO 2 1/2 03/15/51	10'000	0	0	10'000 USD	58.76%	5'335'611.00	0.30	a)
US191216DT43	5.4000 % KO 5.4 05/13/64	0	2'200	0	2'200 USD	96.05%	1'918'700.57	0.11	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	5'000	350	0	5'350 USD	89.97%	4'370'754.75	0.25	a)
US191241AJ70	1.8500 % KOF 1.85 09/01/32	2'250	0	0	2'250 USD	78.97%	1'613'405.08	0.09	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	1'300	100	0	1'400 USD	103.19%	1'311'785.37	0.07	a)
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	2'000	0	0	2'000 USD	97.68%	1'773'875.68	0.10	a)
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	9'242	0	1'242	8'000 USD	75.61%	5'492'467.55	0.31	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	10'000	300	0	10'300 USD	81.85%	7'654'893.28	0.44	a)
US224044CJ43	3.5000 % COXENT 3 1/2 08/15/27 144A	1'675	0	0	1'675 USD	96.76%	1'471'719.09	0.08	a)
US224044CL98	1.8000 % COXENT 1.8 10/01/30 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAR24	3.3000 % CCI 3.3 07/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	91.02%	1'652'941.58	0.09	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	8'500	400	0	8'900 USD	84.45%	6'824'706.75	0.39	a)
US23291KAH86	2.6000 % DHR 2.6 11/15/29	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	5'000	150	0	5'150 USD	95.09%	4'446'609.61	0.25	a)
US235851AW20	2.8000 % DHR 2.8 12/10/51	0	5'000	0	5'000 USD	61.19%	2'778'224.38	0.16	a)
US24422EVP14	1.5000 % DE 1 1/2 03/06/28 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	91.31%	4'145'656.87	0.24	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	5'000	200	5'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	2'891	0	0	2'891 USD	66.82%	1'754'087.79	0.10	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	10'000	0	0	10'000 USD	102.58%	9'314'776.90	0.53	a)
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US249670AB66	3.3750 % DEPTCC 3 3/8 PERP D	3'250	0	0	3'250 USD	95.42%	2'816'028.77	0.16	a)
US251526CB33	3.9610 % DB 3.961 11/26/25	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	3'600	0	0	3'600 USD	87.99%	2'876'310.12	0.16	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	2'000	200	0	2'200 USD	97.95%	1'956'736.97	0.11	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	4'118	0	4'118	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DAR08	3.9500 % WBD 3.95 03/20/28	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25746UDT34	6.8750 % D 6 7/8 02/01/55 A	0	5'000	0	5'000 USD	103.99%	4'721'315.17	0.27	a)
US25746UDV89	6.6250 % D 6 5/8 05/15/55	0	4'000	0	4'000 USD	101.39%	3'682'687.58	0.21	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US26441CCG87	6.4500 % DUK 6.45 09/01/54	0	5'300	0	5'300 USD	100.61%	4'841'974.13	0.28	a)
US26442UAN46	3.4000 % DUK 3.4 04/01/32	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26442UAP93	4.0000 % DUK 4 04/01/52	2'250	0	0	2'250 USD	76.02%	1'553'071.97	0.09	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	6'100	200	3'100	3'200 USD	99.68%	2'896'374.40	0.17	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	3'500	0	0	3'500 USD	86.87%	2'761'007.75	0.16	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	2'300	0	0	2'300 USD	83.45%	1'742'865.77	0.10	a)
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NAS45	5.5000 % ENBCN 5 1/2 07/15/2077	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	10'000	0	0	10'000 USD	80.34%	7'295'364.51	0.42	a)
US29274FAF18	4.0000 % ENELIM 4 10/25/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	2'000	200	0	2'200 USD	92.23%	1'842'507.91	0.10	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	90.61%	3'291'027.45	0.19	a)
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	6'000	0	0	6'000 USD	92.11%	5'018'320.16	0.29	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	5'615	300	0	5'915 USD	94.05%	5'051'265.81	0.29	a)
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	5'000	200	0	5'200 USD	103.78%	4'900'346.31	0.28	a)
US36266GAA58	4.8000 % GEHC 4.8 08/14/29	0	920	0	920 USD	99.41%	830'435.33	0.05	a)
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	1'100	100	0	1'200 USD	103.81%	1'131'176.05	0.06	a)
US370334CT90	4.9500 % GIS 4.95 03/29/33	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	2'600	200	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	100.70%	2'743'191.81	0.16	a)
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	1'700	0	0	1'700 USD	102.19%	1'577'414.52	0.09	a)
US375558BX02	1.2000 % GILD 1.2 10/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	91.53%	4'155'827.03	0.24	a)
US377373AH85	3.3750 % GSK 3 3/8 06/01/29	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37940X AQ51	5.4000 % GPN 5.4 08/15/32	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141EC238	3.8500 % GS 3.85 07/08/24 MTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GW866	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	10'000	0	0	10'000 USD	98.39%	8'934'213.15	0.51	a)
US38141GWQ36	3.2720 % GS 3.272 09/29/25	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GYJ74	2.3830 % GS 2.383 07/21/32	0	5'000	0	5'000 USD	84.15%	3'820'711.18	0.22	a)
US404280AU33	4.2500 % HSBC 4 1/4 08/18/25	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280AW98	4.3000 % HSBC 4.3 03/08/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280DL07	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/02/36	3'000	2'000	0	5'000 USD	103.08%	4'680'135.10	0.27	a)
US437076CC49	3.3000 % HD 3.3 04/15/40	7'000	0	0	7'000 USD	77.86%	4'948'863.42	0.28	a)
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	1'750	0	0	1'750 USD	95.81%	1'522'441.17	0.09	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	3'300	0	0	3'300 USD	90.57%	2'713'869.06	0.15	a)
US44891CCB72	5.5000 % HYNMTR 5 1/2 03/30/26 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	3'550	0	0	3'550 USD	103.23%	3'327'731.29	0.19	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	3'000	0	0	3'000 USD	97.27%	2'649'807.95	0.15	a)
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	92.04%	5'014'615.32	0.29	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	3'550	0	3'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	3'500	0	3'500 USD	100.69%	3'200'199.75	0.18	a)
US458140CA64	4.1500 % INTC 4.15 08/05/32	8'000	200	8'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	3'900	0	0	3'900 USD	93.70%	3'318'357.94	0.19	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	6'000	0	0	6'000 USD	91.22%	4'969'721.33	0.28	a)
US46625HRX07	3.6250 % JPM 3 5/8 12/01/27	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PAF36	3.5400 % JPM 3.54 05/01/28	8'000	0	0	8'000 USD	97.38%	7'074'218.01	0.40	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	90.53%	2'466'118.51	0.14	a)
US46647PBP09	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	7'000	400	3'000	4'400 USD	89.93%	3'592'881.44	0.20	a)
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	5'000	0	0	5'000 USD	73.91%	3'355'789.58	0.19	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	4'500	0	0	4'500 USD	86.87%	3'549'540.21	0.20	a)
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	8'000	0	0	8'000 USD	100.29%	7'285'466.76	0.42	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	5'000	0	0	5'000 USD	78.81%	3'578'171.03	0.20	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	5'100	300	0	5'400 USD	84.16%	4'126'662.28	0.24	a)
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	650	200	0	850 USD	99.74%	769'866.58	0.04	a)
US49456BAR24	2.0000 % KMI 2 02/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	84.04%	3'815'807.71	0.22	a)
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	15'000	0	0	15'000 USD	81.26%	11'067'812.83	0.63	a)
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	5'000	0	0	5'000 USD	56.16%	2'549'759.00	0.15	a)
US53944YAF07	4.4500 % LLOYDS 4.45 05/08/25	10'000	0	5'000	5'000 USD	99.89%	4'535'391.93	0.26	a)
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'400	0	0	4'400 USD	78.19%	3'123'938.99	0.18	a)
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	10'000	300	0	10'300 USD	88.16%	8'245'623.39	0.47	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	5'000	200	0	5'200 USD	95.27%	4'498'374.37	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	3'800	200	0	4'000 USD	101.30%	3'679'563.89	0.21	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	10'000	0	0	10'000 USD	75.49%	6'855'232.67	0.39	a)
US57636QAM69	2.9500 % MA 2.95 06/01/29	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	87.76%	3'984'478.00	0.23	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	3'450	350	0	3'800 USD	97.07%	3'349'315.18	0.19	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	1'700	100	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	8'000	0	0	8'000 USD	68.09%	4'946'475.25	0.28	a)
US58933YBM66	5.0000 % MRK 5 05/17/53	1'300	0	0	1'300 USD	91.32%	1'078'024.25	0.06	a)
US59156RBZ01	4.5500 % MET 4.55 03/23/30	5'000	0	0	5'000 USD	98.82%	4'486'584.25	0.26	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GFP90	5.1500 % MET 5.15 03/28/33 144A	0	5'000	0	5'000 USD	99.10%	4'499'296.95	0.26	a)
US59217HBM88	3.0000 % MET 3 09/19/27 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	13'722	0	3'722	10'000 USD	61.08%	5'546'187.79	0.32	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	11'278	0	6'278	5'000 USD	65.45%	2'971'548.22	0.17	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	5'000	200	0	5'200 USD	83.80%	3'957'013.12	0.23	a)
US606822AD62	3.8500 % MUFG 3.85 03/01/26	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822CN27	5.3540 % MUFG 5.354 09/13/28	5'000	0	0	5'000 USD	101.33%	4'600'453.72	0.26	a)
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	8'000	0	3'000	5'000 USD	99.37%	4'511'601.02	0.26	a)
US61747YEK73	2.4750 % MS 2.475 01/21/28	8'000	0	0	8'000 USD	95.51%	6'937'937.86	0.40	a)
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61772BAC72	3.2170 % MS 3.217 04/22/42	8'000	0	0	8'000 USD	74.28%	5'395'851.03	0.31	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	8'000	200	0	8'200 USD	85.69%	6'380'485.97	0.36	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	2'700	0	0	2'700 USD	97.61%	2'393'114.02	0.14	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	4'000	0	0	4'000 USD	101.65%	3'692'131.30	0.21	a)
US637639AB13	1.5000 % NSCCLF 1 1/2 04/23/25 144A	5'000	250	0	5'250 USD	99.35%	4'736'036.93	0.27	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	95.72%	1'738'280.12	0.10	a)
US641062AS38	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 144A	5'000	0	0	5'000 USD	91.55%	4'156'735.08	0.24	a)
US64110LAV80	4.8750 % NFLX 4 7/8 06/15/30 144A	0	5'000	0	5'000 USD	99.62%	4'522'815.44	0.26	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	6'000	9'000	0	15'000 USD	98.64%	13'435'507.80	0.77	a)
US64952XCS80	3.0000 % NYLIFE 3 01/10/28 REGS	7'850	0	7'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65163LAN91	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26 144A	0	3'025	3'025	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65163LAQ23	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26	0	3'025	0	3'025 USD	100.98%	2'773'880.27	0.16	a)
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	86.97%	3'948'564.62	0.23	a)
US65339KCB44	3.8000 % NEE 3.80 03/05/2082	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	15'000	0	0	15'000 USD	77.66%	10'577'193.41	0.60	a)
US65535HBR93	5.5940 % NOMURA 5.594 07/02/27	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67066GAE44	3.2000 % NVDA 3.2 09/16/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	91.75%	4'165'770.18	0.24	a)
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US674599EF81	6.1250 % OXY 6 1/8 01/01/31	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBE40	3.9000 % ORCL 3.9 05/15/35	12'000	3'000	0	15'000 USD	87.56%	11'926'601.12	0.68	a)
US68389XBU81	2.8000 % ORCL 2.8 04/01/27	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6944PM2E61	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 REGS	10'000	400	0	10'400 USD	91.08%	8'601'340.18	0.49	a)
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	10'000	0	0	10'000 USD	61.56%	5'589'955.80	0.32	a)
US71427QAA67	1.2500 % RIFP 1 1/4 04/01/28 144A	8'000	0	0	8'000 USD	89.74%	6'518'709.34	0.37	a)
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	6'000	0	0	6'000 USD	93.80%	5'110'614.37	0.29	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	8'500	400	3'900	5'000 USD	96.64%	4'387'697.60	0.25	a)
US74256LFA26	4.6000 % PFG 4.6 08/19/27 144A	0	840	840	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XCB55	2.2500 % PLD 2 1/4 01/15/32	3'000	150	0	3'150 USD	83.33%	2'383'535.90	0.14	a)
US744320AY89	3.9050 % PRU 3.905 12/07/47	7'753	0	0	7'753 USD	76.36%	5'375'758.85	0.31	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	6'000	400	0	6'400 USD	88.96%	5'169'695.73	0.29	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	6'800	300	0	7'100 USD	87.92%	5'668'596.56	0.32	a)
US747525BP77	1.6500 % QCOM 1.65 05/20/32	5'071	0	0	5'071 USD	79.89%	3'678'712.05	0.21	a)
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	4'000	0	0	4'000 USD	96.43%	3'502'421.49	0.20	a)
US771196BW19	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US775109BB60	5.0000 % RCICN 5 03/15/44	5'000	0	0	5'000 USD	87.64%	3'979'029.70	0.23	a)
US78016HZS20	5.2000 % RY 5.2 08/01/28 GMTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	5'000	300	0	5'300 USD	85.44%	4'111'796.60	0.23	a)
US78081BAM54	3.5500 % RPRX 3.55 09/02/50	8'000	5'000	0	13'000 USD	66.58%	7'859'654.02	0.45	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	4'400	400	0	4'800 USD	100.97%	4'400'875.22	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US79466LAF13	3.7000 % CRM 3.7 04/11/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	2'200	0	0	2'200 USD	90.23%	1'802'553.71	0.10	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	4'700	0	4'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	4'000	250	0	4'250 USD	89.41%	3'450'444.71	0.20	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	5'900	400	0	6'300 USD	102.79%	5'880'437.36	0.34	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	2'550	800	0	3'350 USD	98.48%	2'995'851.27	0.17	a)
US852234AN39	2.7500 % SQ 2 3/4 06/01/26	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244AK58	2.4500 % SBUX 2.45 06/15/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	6'000	0	0	6'000 USD	69.81%	3'803'294.78	0.22	a)
US863667AJ04	4.6250 % SYK 4 5/8 03/15/46	0	5'000	0	5'000 USD	87.06%	3'952'923.26	0.23	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	2'500	200	0	2'700 USD	102.59%	2'515'210.42	0.14	a)
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	101.18%	2'756'158.76	0.16	a)
US86964WAK80	3.1250 % SUZANO 3 1/8 01/15/32 DM3N	3'000	0	0	3'000 USD	83.62%	2'277'879.75	0.13	a)
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	5'000	5'000	0	10'000 USD	65.95%	5'988'862.17	0.34	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	91.09%	4'135'804.53	0.24	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	8'000	500	0	8'500 USD	86.51%	6'676'823.55	0.38	a)
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	4'900	0	0	4'900 USD	85.10%	3'786'522.19	0.22	a)
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	86.37%	3'921'368.52	0.22	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	5'550	300	0	5'850 USD	86.73%	4'606'912.22	0.26	a)
US883556CM25	2.8000 % TMO 2.8 10/15/41	0	5'000	0	5'000 USD	70.54%	3'202'783.16	0.18	a)
US89114QCA40	2.6500 % TD 2.65 06/12/24 MTN	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US891160MJ94	3.6250 % TD 3 5/8 09/15/31	2'000	0	0	2'000 USD	97.40%	1'768'881.40	0.10	a)
US902613BH06	5.6990 % UBS 5.699 02/08/35 144A	0	5'000	0	5'000 USD	101.24%	4'596'367.49	0.26	a)
US90352JAC71	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US90353TAN00	4.3000 % UBER 4.3 01/15/30	0	5'000	0	5'000 USD	97.16%	4'411'352.30	0.25	a)
US912797KJ59	0.0000 % B 03/20/25	0	10'000	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PCP53	3.7500 % UNH 3 3/4 07/15/25	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	14'000	0	0	14'000 USD	79.50%	10'106'215.12	0.58	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	2'666	400	3'066	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VFW90	2.9870 % VZ 2.987 10/30/56	5'000	0	0	5'000 USD	59.26%	2'690'415.94	0.15	a)
US92343VGK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	10'000	0	0	10'000 USD	76.01%	6'901'906.44	0.39	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	5'000	0	0	5'000 USD	69.36%	3'149'117.40	0.18	a)
US92343VGX64	4.7800 % VZ 4.78 02/15/35 144A	0	5'000	0	5'000 USD	95.41%	4'331'852.53	0.25	a)
US92556VAD82	2.7000 % VTRS 2.7 06/22/30	0	500	0	500 USD	87.12%	395'551.12	0.02	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	20'000	0	0	20'000 USD	67.79%	12'311'341.90	0.70	a)
US92826CAD48	3.1500 % V 3.15 12/14/25	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000	0	0	10'000 USD	85.57%	7'769'820.63	0.44	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBU36	4.2500 % VOD 4 1/4 09/17/50	5'000	0	0	5'000 USD	77.00%	3'495'947.10	0.20	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	4'000	100	0	4'100 USD	90.04%	3'352'082.01	0.19	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	3'300	0	0	3'300 USD	90.58%	2'714'198.68	0.15	a)
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'600	0	2'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	2'100	100	0	2'200 USD	101.51%	2'027'935.35	0.12	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	2'200	200	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	4'200	300	0	4'500 USD	103.16%	4'215'227.12	0.24	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	2'500	0	0	2'500 USD	95.24%	2'162'112.45	0.12	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	5'000	2'250	0	7'250 USD	101.09%	6'655'121.15	0.38	a)
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	100.63%	1'370'587.97	0.08	a)
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	3'000	0	0	3'000 USD	86.86%	2'366'114.97	0.13	a)
USF8500RAA08	5.3750 % SOCGEN 5 3/8 PERP REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF8500RAB80	4.7500 % SOCGEN 4 3/4 PERP REGS	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF8500RAC63	9.3750 % SOCGEN 9 3/8 PERP REGS	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	6'500	0	0	6'500 USD	97.37%	5'746'916.78	0.33	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	3'800	200	0	4'000 USD	100.08%	3'635'251.05	0.21	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	4'900	0	0	4'900 USD	93.83%	4'174'914.24	0.24	a)
USG7420TAD84	2.7500 % RKTLN 2 3/4 06/26/24 REGS	4'000	400	4'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	82.81%	3'759'871.83	0.21	a)
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	8'800	200	0	9'000 USD	95.86%	7'834'274.02	0.45	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	83.29%	2'873'823.88	0.16	a)
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	300	0	0	300 USD	109.14%	297'308.28	0.02	a)
USH42097EZ68	6.8500 % UBS 6.85 PERP REGS	0	8'000	0	8'000 USD	100.18%	7'277'621.21	0.41	a)
USH4209UAT37	7.0000 % UBS 7 PERP REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ1121LAA38	6.2000 % DAIL 6.2 PERP REGS	0	6'000	0	6'000 USD	101.13%	5'509'647.86	0.31	a)
USJ5539RAJ36	4.2390 % NTT 4.239 07/25/25 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	100.80%	5'492'104.33	0.31	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	1'400	200	0	1'600 USD	101.55%	1'475'399.64	0.08	a)
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	90.45%	1'642'571.65	0.09	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN82008AX66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 REGS	5'000	300	5'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	92.47%	4'198'550.79	0.24	a)
USPOR808AG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	3'450	200	0	3'650 USD	94.01%	3'115'817.84	0.18	a)
USP15075AL18	5.6210 % BSMXB 5.621 12/10/29 REGS	0	1'750	0	1'750 USD	99.91%	1'587'625.54	0.09	a)
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	700	0	700 USD	101.08%	642'487.15	0.04	a)
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	0	200	0	200 USD	76.68%	139'256.73	0.01	a)
USP87026AA16	6.0000 % SILAMX 6 11/25/29 REGS	0	4'550	0	4'550 USD	100.11%	4'136'130.97	0.24	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	6'000	2'000	0	8'000 USD	85.07%	6'179'461.86	0.35	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	101.54%	9'220'702.92	0.53	a)
USQ1269WAA38	5.6980 % BZLNZ 5.698 01/28/35 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	100.35%	6'378'470.10	0.36	a)
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU01386AE82	5.3750 % ALC5W 5 3/8 12/06/32 REGS	800	3'200	0	4'000 USD	100.61%	3'654'356.42	0.21	a)
USU09513KE89	4.8500 % BMW 4.85 08/13/31 REGS	0	1'570	0	1'570 USD	98.35%	1'402'143.98	0.08	a)
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'956	0	0	1'956 USD	87.31%	1'550'681.85	0.09	a)
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	12'000	3'000	0	15'000 USD	86.42%	11'770'643.53	0.67	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	9'500	0	0	9'500 USD	59.46%	5'129'215.77	0.29	a)
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	95.44%	4'333'078.39	0.25	a)
USX10001AA78	3.5000 % ALVGR 3 1/2 PERP REGS	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	6'000	4'000	0	10'000 USD	88.42%	8'028'978.10	0.46	a)
USX10001AD18	5.6000 % ALVGR 5.6 09/03/54 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	4'000	200	0	4'200 USD	96.36%	3'674'796.63	0.21	a)
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	104.52%	4'745'242.29	0.27	a)
USY555CCAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	3'800	0	3'800 USD	99.68%	3'439'410.09	0.20	a)
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	84.74%	2'693'153.71	0.15	a)
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	99.36%	4'511'101.60	0.26	a)
XS1395052639	4.0500 % STANLN 4.05 04/12/26 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	99.69%	4'526'039.02	0.26	a)
XS1650033571	5.0000 % BOAD 5 07/27/27 REGS	4'000	100	0	4'100 USD	97.50%	3'629'967.11	0.21	a)
XS1681539539	4.1250 % STOAU 4 1/8 09/14/27 EMTN	1'200	200	0	1'400 USD	97.19%	1'235'572.74	0.07	a)
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	7'200	0	7'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2283175516	1.4560 % STANLN 1.456 01/14/27 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	96.81%	4'395'279.82	0.25	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	10'000	0	0	10'000 USD	84.92%	7'711'251.41	0.44	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	14'300	300	0	14'600 USD	91.49%	12'128'651.32	0.69	a)
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	5'900	0	5'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2532384372	6.2530 % BKIR 6.253 09/16/26 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	102.67%	5'593'769.61	0.32	a)
USD							1'103'038'471.95	62.86	

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

							100'946'060.49	5.75	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							100'946'060.49	5.75	
LU2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	1'002	0	0	1'002 CHF	100'704.37	100'946'060.49	5.75	a)
CHF							100'946'060.49	5.75	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente							-12'609'695.32	-0.72	
Futures							0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	-100	120	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	300	300	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/24	US 10YR NOTE (CBT)SEP24	0	350	350	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/24	US 10YR NOTE (CBT)DEC24	0	300	300	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/25	EURO-BUND FUTURE MAR25	0	0	50	-50 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/25	US 10YR NOTE (CBT)MAR25	0	100	300	-200 USD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte									
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		226'742'640	240'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		561'582'596	652'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.02.2024		15'000'000	12'880'785	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.03.2024		11'597'843	1'970'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		219'211'525	235'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.03.2024		54'032'650	50'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.03.2024		44'385'040	70'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.03.2024		9'612'650	17'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		517'213'290	605'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.03.2024		1'000'000'000	5'927'910	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		225'945'776	238'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		547'950'624	624'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.05.2024		9'804'580	17'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.05.2024		57'218'073	51'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.05.2024		45'619'630	70'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.05.2024		216'201'825	225'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.05.2024		5'452'720	920'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.05.2024		530'206'800	600'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		10'000'000	9'010'150	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		8'000'000	7'820'032	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		12'000'000	11'675'988	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		30'000'000	27'320'130	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		11'000'000	10'735'604	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		8'000'000	7'814'344	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		10'000'000	9'104'670	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.06.2024		227'917'805	235'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.06.2024		558'463'140	620'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.07.2024		5'350'527	920'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.07.2024		10'130'861	17'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		488'827'605	543'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		179'253'168	184'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.07.2024		46'131'540	70'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.07.2024		57'645'147	51'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		18'025'640	20'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		18'069'200	20'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		218'469'640	230'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		560'048'410	635'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		4'000'000	3'810'776	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		3'000'000	2'828'802	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 26.09.2024		5'261'922	920'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		45'648'172	71'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 26.09.2024		58'260'258	51'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		177'338'464	184'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.09.2024		9'967'066	17'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		524'940'372	594'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		7'565'688	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		25'429'950	30'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		4'382'630	7'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.09.2024		3'432'906	6'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		209'712'545	223'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		546'005'850	650'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		13'231'762	23'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.11.2024		5'411'569	920'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		186'867'368	199'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.11.2024		49'283'281	79'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		57'341'901	51'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		560'148'785	665'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.11.2024		3'000'000	2'827'137	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 21.11.2024		15'000'000	13'003'665	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.12.2024		210'927'382	226'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.12.2024		524'725'660	610'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 19.12.2024		4'000'000	3'716'208	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.12.2024		8'796'470	10'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.01.2025		13'105'239	23'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 23.01.2025		5'288'096	920'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		170'810'696	184'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.01.2025		49'525'258	79'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.01.2025		56'493'210	51'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.01.2025		552'381'480	630'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		938'806	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		5'646'666	6'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.02.2025		217'077'528	232'000'000	CHF/EUR		-1'635'523.36	-0.09	b)
	USD/CHF Verfall 20.02.2025		561'015'000	630'000'000	CHF/USD		-9'818'451.42	-0.56	b)
	AUD/CHF Verfall 27.03.2025		12'943'250	23'000'000	CHF/AUD		-8'696.40	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 27.03.2025		5'370'675	920'000'000	CHF/JPY		-25'024.23	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 27.03.2025		50'737'428	81'000'000	CHF/CAD		138'927.18	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 27.03.2025		169'801'711	181'000'000	CHF/EUR		-468'122.45	-0.03	b)
	GBP/CHF Verfall 27.03.2025		54'180'966	49'000'000	CHF/GBP		-762'339.35	-0.04	b)
	USD/CHF Verfall 27.03.2025		550'562'820	610'000'000	CHF/USD		-30'465.29	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							-12'609'695.32	-0.72	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	29'053'224.69	1.66
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'617'375'441.80	92.17
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	100'946'060.49	5.75
Derivative Finanzinstrumente	-12'609'695.32	-0.72
Sonstige Vermögenswerte	20'053'229.54	1.14
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'754'818'261.20	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-255'371.05	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'754'562'890.15	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'718'321'502.29	97.92
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-12'609'695.32	-0.72
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

						179'241'725.11	10.21
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte						179'241'725.11	10.21
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	1'000	EUR	86.72%		818'627.91	0.05
DE000A3L69X8	3.3750 % TRAGR 3 3/8 01/14/28 EMTN	1'300	EUR	100.33%		1'231'220.27	0.07
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	1'200	EUR	97.25%		1'101'610.63	0.06
FR001400KKC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	1'100	EUR	107.13%		1'112'348.27	0.06
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	6'000	EUR	105.22%		5'959'571.93	0.34
FR001400OXS4	4.5000 % ORAFP 4 1/2 PERP	1'000	EUR	102.53%		967'878.69	0.06
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	700	EUR	105.02%		693'942.01	0.04
FR001400WRE9	4.2500 % RCFFP 4 1/4 01/21/30 EMTN	1'800	EUR	100.41%		1'706'074.86	0.10
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	3'000	USD	94.18%		2'565'468.26	0.15
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	2'500	USD	67.01%		1'521'142.66	0.09
US022095BM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	1'100	USD	72.26%		721'772.62	0.04
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	1'800	USD	72.08%		1'178'091.36	0.07
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	11'000	USD	69.84%		6'976'003.32	0.40
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	2'000	USD	99.74%		1'811'414.46	0.10
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000	USD	76.59%		10'432'132.43	0.59
US05565QDX34	6.1250 % BPLN 6 1/8 PERP	500	USD	98.65%		447'882.04	0.03
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	1'000	USD	82.26%		746'916.53	0.04
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	800	USD	86.29%		626'874.13	0.04

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.01.2025 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	6'200 USD	90.75%	5'108'974.43	0.29
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	1'100 USD	95.98%	958'721.01	0.05
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'600 USD	83.85%	1'979'734.24	0.11
US17325FBK30	4.8380 % C 4.838 08/06/29	500 USD	100.08%	454'365.52	0.03
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	500 USD	97.68%	443'468.92	0.03
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	900 USD	75.61%	617'902.60	0.04
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	1'000 USD	81.85%	743'193.52	0.04
US38141GWB66	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	1'000 USD	98.39%	893'421.31	0.05
US38141GYJ74	2.3830 % GS 2.383 07/21/32	4'100 USD	84.15%	3'132'983.17	0.18
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	500 USD	90.57%	411'192.28	0.02
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	2'070 USD	103.23%	1'940'395.43	0.11
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	5'200 USD	92.04%	4'345'999.94	0.25
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	1'000 USD	90.53%	822'039.50	0.05
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	3'100 USD	100.29%	2'823'118.37	0.16
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	15'000 USD	81.26%	11'067'812.83	0.63
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'000 USD	101.30%	919'890.97	0.05
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	9'500 USD	61.08%	5'268'878.40	0.30
US606822CN27	5.3540 % MUFG 5.354 09/13/28	4'600 USD	101.33%	4'232'417.42	0.24
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	1'000 USD	86.97%	789'712.92	0.05
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	1'900 USD	77.66%	1'339'777.83	0.08
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	1'000 USD	88.96%	807'764.96	0.05
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	4'200 USD	102.79%	3'920'291.58	0.22
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	1'000 USD	98.48%	894'283.96	0.05
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	300 USD	102.59%	279'467.82	0.02
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	1'000 USD	101.18%	918'719.59	0.05
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	1'000 USD	91.09%	827'160.91	0.05
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	500 USD	86.73%	393'753.18	0.02
US902613BH06	5.6990 % UBS 5.699 02/08/35 144A	5'000 USD	101.24%	4'596'367.49	0.26
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000 USD	85.57%	7'769'820.63	0.44
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	2'500 USD	95.24%	2'162'112.45	0.12
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	1'500 USD	101.09%	1'376'921.62	0.08
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	1'500 USD	100.63%	1'370'587.97	0.08
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	2'000 USD	86.86%	1'577'409.98	0.09
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	200 USD	100.08%	181'762.55	0.01
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	2'000 USD	93.83%	1'704'046.63	0.10
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	2'700 USD	82.81%	2'030'330.79	0.12
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	2'100 USD	95.86%	1'827'997.27	0.10
USH42097EZ68	6.8500 % UBS 6.85 PERP REGS	1'495 USD	100.18%	1'360'005.46	0.08
USJ1121LAA38	6.2000 % DAIL 6.2 PERP REGS	1'800 USD	101.13%	1'652'894.36	0.09
USJ539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	6'000 USD	100.80%	5'492'104.33	0.31
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	1'600 USD	101.55%	1'475'399.64	0.08
USP0R80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	3'016 USD	94.01%	2'574'604.55	0.15
USP1507SAL18	5.6210 % BSMXB 5.621 12/10/29 REGS	1'750 USD	99.91%	1'587'625.54	0.09
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	200 USD	76.68%	139'256.73	0.01
USP87026AA16	6.0000 % SILAMX 6 11/25/29 REGS	700 USD	100.11%	636'327.84	0.04
USQ1269WAA38	5.6980 % BZLNZ 5.698 01/28/35 REGS	7'000 USD	100.35%	6'378'470.10	0.36
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	200 USD	100.61%	182'717.82	0.01
USU09513KE89	4.8500 % BMW 4.85 08/13/31 REGS	700 USD	98.35%	625'159.74	0.04
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	705 USD	59.46%	380'641.80	0.02
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	1'000 USD	88.42%	802'897.81	0.05
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	500 USD	96.36%	437'475.79	0.02
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	1'100 USD	104.52%	1'043'953.30	0.06
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500 USD	84.74%	2'693'153.71	0.15
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	3'500 USD	99.36%	3'157'771.12	0.18
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	4'700 USD	99.69%	4'254'476.68	0.24
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	500 EUR	90.84%	428'731.38	0.02
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	2'700 EUR	91.01%	2'319'507.74	0.13
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	300 EUR	87.71%	248'386.29	0.01
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	6'000 EUR	88.47%	5'010'997.38	0.29
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'905 EUR	91.35%	1'642'709.60	0.09
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	1'200 EUR	114.17%	1'293'251.24	0.07

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2025	Wäh- rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	3'684	USD	102.67%	3'434'574.54	0.20	
XS2602037629	6.3750 % NNGRNV 6 3/8 PERP	500	EUR	105.01%	495'606.79	0.03	
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	1'800	EUR	104.15%	1'769'724.74	0.10	
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	1'000	EUR	107.26%	1'012'471.74	0.06	
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	300	EUR	105.00%	297'349.91	0.02	
XS2774944008	6.8750 % ABNANV 6 7/8 PERP	4'500	EUR	107.75%	4'577'064.74	0.26	
XS2959514519	6.0000 % AIB 6 PERP	300	EUR	100.51%	284'640.33	0.02	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56639619
CAD	1 = CHF	0.62699810
EUR	1 = CHF	0.94396798
GBP	1 = CHF	1.12829753
JPY	100 = CHF	0.58640600
USD	1 = CHF	0.90805000

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	10'118'036.45	5.259
Bond	CHF	182'188'717.84	94.702
Equity	CHF	74'733.16	0.039
Total	CHF	192'381'487.45	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	1'663'041'643.79	94.784
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	37'911.86	0.002
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.01.2025

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

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	179'241'725.11
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: 01.02.2024 - 31.01.2025

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000
BA CHF	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000
CT CHF	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000
DA CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
DT CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000
MT CHF	-	-	-	-	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

Benchmark

Dieser Fonds 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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2024 / 2025

Ex-Datum: 06.05.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 09.05.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Ja	CHF	2.05000	0.71750	1.33250
BA CHF	Ja	CHF	2.25000	0.78750	1.46250
DA CHF	Ja	CHF	2.55000	0.89250	1.65750

Thesaurierung des Nettoertrags 2024 / 2025

Ex-Datum: 06.05.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 09.05.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Ja	CHF	2.617	0.915	1.702
DT CHF	Ja	CHF	2.717	0.950	1.767
GT CHF	Ja	CHF	3.076	1.076	2.000
MT CHF	Ja	CHF	3.107	1.087	2.020
NT CHF	Ja	CHF	3.578	1.252	2.326

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 Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Übersicht

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		125'184'341.95	67'847'497.11	47'823'862.75
Klasse AAH1 EUR	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'282'644.45	28'774'000.47	32'163'915.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		233'816.721	267'020.066	308'480.512
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		108.1302	107.7597	104.2656
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		108.1302	107.6304	104.1405
Ausschüttung je Anteil		3.65	2.05	0.90
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BAH1 EUR	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		315'183.27	314'155.75	320'457.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'402.911	3'589.191
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.6217	92.3197	89.2841
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.6217	92.2089	89.1769
Ausschüttung je Anteil		3.50	2.15	1.10
Total Expense Ratio (TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CTH1 EUR	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'026'544.38	5'829'470.74	6'646'053.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		51'412.106	60'784.456	72'292.551
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		97.7697	95.9040	91.9328
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		97.7697	95.7889	91.8224
Thesaurierung je Anteil		3.75	2.26	1.08
Total Expense Ratio (TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DAH1 EUR	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		680'622.29	678'677.71	974'209.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	7'525.321	11'167.953
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.4443	90.1859	87.2326
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		90.4443	90.0777	87.1279
Ausschüttung je Anteil		3.55	2.25	1.25
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %	0.44 %	0.38 %
Klasse GTH1 EUR	EUR			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'238'970.15	4'541'258.12	7'719'226.85
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		37'186.000	40'640.000	72'141.628
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		113.9937	111.7436	107.0010
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		113.9937	111.6095	106.8726
Thesaurierung je Anteil		4.53	2.85	1.54
Total Expense Ratio (TER)		0.43 %	0.35 %	0.30 %
Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		28'246'248.49	27'709'934.32	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		245'101.557	258'886.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		108.7857	99.7395	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		108.7857	99.6198	
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		4.89	0.13	
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	
Klasse NTH1 CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		61'394'128.92		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		574'530.964		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.8720		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.8720		
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		4.00		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %		

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

Performance

	2024 / 2025	2023 / 2024	2022 / 2023
Klasse AAH1 EUR	2.43 %	4.25 %	-10.32 %
Klasse BAH1 EUR	2.86 %	4.69 %	-9.94 %
Klasse CTH1 EUR	2.92 %	4.75 %	-9.89 %
Klasse DAH1 EUR	2.87 %	4.89 %	-9.52 %
Klasse GTH1 EUR	2.94 %	4.96 %	-9.45 %
Klasse NT CHF (Lancierung 19.01.2024)	9.12 %	-0.14 %	-
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 28.03.2024)	0.99 %	-	-

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2025	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	3'851'808.45	2'007'320.71
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	119'729'973.67	65'043'288.02
Sonstige Vermögenswerte	1'629'324.77	829'535.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	125'211'106.89	67'880'144.28
Andere Verbindlichkeiten	-26'764.94	-32'647.17
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	125'184'341.95	67'847'497.11

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Klasse AAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		267'020.066	308'480.512
Ausgegebene Anteile		1'313.715	1'574.590
Zurückgenommene Anteile		-34'517.060	-43'035.036
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		233'816.721	267'020.066
Klasse BAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'402.911	3'589.191
Zurückgenommene Anteile		-	-186.280
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'402.911
Klasse CTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		60'784.456	72'292.551
Ausgegebene Anteile		683.000	886.095
Zurückgenommene Anteile		-10'055.350	-12'394.190
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		51'412.106	60'784.456
Klasse DAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'525.321	11'167.953
Zurückgenommene Anteile		-	-3'642.632
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	7'525.321
Klasse GTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		40'640.000	72'141.628
Ausgegebene Anteile		1'522.000	1'632.000
Zurückgenommene Anteile		-4'976.000	-33'133.628
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		37'186.000	40'640.000
Klasse NT CHF			
			<i>Lancierung</i> 19.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		258'886.000	-
Ausgegebene Anteile		90'481.557	259'229.000
Zurückgenommene Anteile		-104'266.000	-343.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		245'101.557	258'886.000
Klasse NTH1 CHF			
			<i>Lancierung</i> 28.03.2024
Ausgegebene Anteile		652'438.964	
Zurückgenommene Anteile		-77'908.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		574'530.964	

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		67'847'497.11	47'823'862.75
Ausbezahlte Ausschüttung		-553'286.83	-283'534.99
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-94'534.95	-65'443.89
Saldo aus dem Anteilverkehr		52'323'059.53	18'403'018.49
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		5'661'607.09	1'969'594.75
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		125'184'341.95	67'847'497.11

Erfolgsrechnung

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		48'421.03	18'651.62
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		20.99	-20.99
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'839'276.84	1'289'392.88
Erträge aus Wertpapierleihe		0.00	6'880.47
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		680'175.62	7'802.70
Total Ertrag		5'567'894.48	1'322'706.68
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-0.05
Reglementarische Vergütungen		-335'681.26	-377'591.33
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-476'132.41	-83'866.05
Total Aufwand		-811'813.67	-461'457.43
Nettoertrag / Verlust		4'756'080.81	861'249.25
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'005'042.77	-5'060'218.11
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		102'740.52	44'311.16
Realisierter Erfolg		2'853'778.56	-4'154'657.70
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'807'828.53	6'124'252.45
Gesamterfolg		5'661'607.09	1'969'594.75

Verwendung des Erfolges

Klasse AAH1 EUR	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	856'126.73	548'328.72
Vortrag des Vorjahres	1'908.47	970.89
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	858'035.20	549'299.61
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	853'431.03	547'391.14
Vortrag auf neue Rechnung	4'604.17	1'908.47
Total	858'035.20	549'299.61
Klasse BAH1 EUR	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	11'977.75	7'238.74
Vortrag des Vorjahres	72.23	149.75
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12'049.98	7'388.49
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	11'910.19	7'316.26
Vortrag auf neue Rechnung	139.79	72.23
Total	12'049.98	7'388.49
Klasse CTH1 EUR	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	193'206.92	137'630.44
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	193'206.92	137'630.44
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	67'622.42	48'170.66
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	125'584.50	89'459.78
Total	193'206.92	137'630.44
Klasse DAH1 EUR	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	26'737.66	16'777.08
Vortrag des Vorjahres	170.32	325.21
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	26'907.98	17'102.29
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	26'714.89	16'931.97
Vortrag auf neue Rechnung	193.09	170.32
Total	26'907.98	17'102.29
Klasse GTH1 EUR	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	168'708.01	116'008.70
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	168'708.01	116'008.70
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	59'047.80	40'603.04
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	109'660.21	75'405.66
Total	168'708.01	116'008.70
Klasse NT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	1'200'040.52	35'265.57
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'200'040.52	35'265.57
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	420'014.18	12'342.95
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	780'026.34	22'922.62
Total	1'200'040.52	35'265.57
Klasse NTH1 CHF	31.01.2025	
Nettoertrag	2'299'283.22	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'299'283.22	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	804'749.13	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'494'534.09	
Total	2'299'283.22	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							119'729'973.67	95.62	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							119'729'973.67	95.62	
AU3CB0307387	5.6500 % TLSAU 5.65 03/06/34 MTN	0	800	0	800 AUD	102.44%	491'730.17	0.39	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.72%	269'148.00	0.21	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	150	400	0	550 EUR	105.07%	577'874.00	0.46	a)
XS2831094706	4.2660 % CBAAU 4.266 06/04/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.51%	310'539.00	0.25	a)
AU							1'649'291.17	1.32	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0390187533	3.1250 % CCBGBB 3 1/8 01/30/31 EMTN	0	500	0	500 EUR	100.15%	500'750.00	0.40	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	100	0	0	100 EUR	103.78%	103'784.00	0.08	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.00%	412'008.00	0.33	a)
BE6352762387	3.6250 % CCBGBB 3 5/8 06/11/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.03%	412'100.00	0.33	a)
BE							1'428'642.00	1.14	
CA07813ZCK80	5.8500 % BCECN 5.85 11/10/32	700	400	100	1'000 CAD	109.83%	729'527.73	0.58	a)
CA136375DG42	4.7000 % CNRCN 4.7 05/10/53	300	300	600	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13645RAZ79	3.1500 % CP 3.15 03/13/29	400	0	0	400 CAD	99.33%	263'903.42	0.21	a)
CA44810ZCR97	4.3900 % HYDONE 4.39 03/01/34	0	200	0	200 CAD	103.70%	137'751.64	0.11	a)
CA44810ZCS70	4.2500 % HYDONE 4 1/4 01/04/35	0	300	0	300 CAD	101.96%	203'168.22	0.16	a)
CA775109DA61	5.9000 % RCICN 5.9 09/21/33	400	300	0	700 CAD	110.23%	512'524.57	0.41	a)
CA7800867G38	4.8290 % RY 4.829 08/08/34	0	200	0	200 CAD	103.56%	137'574.96	0.11	a)
CA780086ZH08	5.2280 % RY 5.228 06/24/30	0	300	0	300 CAD	107.78%	214'773.40	0.17	a)
CA87971MCB78	5.6000 % TCN 5.6 09/09/30 CAM	500	300	100	700 CAD	108.10%	502'588.57	0.40	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	900	400	200	1'100 CAD	99.15%	724'426.56	0.58	a)
CH1353257798	1.9900 % TD 1.99 06/17/31 EMTN	0	500	0	500 CHF	105.50%	558'811.32	0.45	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63307A3D55	4.9500 % NACN 4.95 02/01/28	0	750	0	750 USD	100.25%	723'230.08	0.58	a)
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	350	0	0	350 USD	96.10%	323'541.78	0.26	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	200	0	0	200 USD	98.64%	189'781.19	0.15	a)
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	300	600	0	900 USD	100.37%	868'966.95	0.69	a)
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	600	0	0	600 USD	82.98%	478'958.75	0.38	a)
US94106BAG68	5.0000 % WCNCN 5 03/01/34	0	300	0	300 USD	97.66%	281'817.68	0.23	a)
XS2892967949	3.4670 % CCDJ 3.467 09/05/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.03%	204'052.00	0.16	a)
CA							7'055'398.82	5.63	
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	600	200	0	800 USD	99.87%	768'574.96	0.61	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	250	0	0	250 USD	102.68%	246'927.76	0.20	a)
USH42097EQ69	6.3010 % UBS 6.301 09/22/34 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	200	200	0	400 USD	109.14%	419'941.20	0.34	a)
CH							1'435'443.92	1.15	
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	400	0	400 USD	101.08%	388'927.93	0.31	a)
CL							388'927.93	0.31	
DE000A14J9N8	2.2410 % ALVGR 2.241 07/07/45	300	0	0	300 EUR	99.48%	298'437.00	0.24	a)
DE000A3823H4	4.8510 % ALVGR 4.851 07/26/54	400	0	0	400 EUR	107.44%	429'752.00	0.34	a)
DE000A383JS3	8.1250 % DB 8 1/8 PERP	0	200	0	200 EUR	107.03%	214'058.00	0.17	a)
DE000A383S52	7.3750 % DB 7 3/8 PERP	0	400	0	400 EUR	103.90%	415'588.00	0.33	a)
DE000A3MQQV5	2.0000 % DBOERS 2 06/23/48	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	300	0	100	200 EUR	100.38%	200'752.00	0.16	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	200	300	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	200	700	0	900 USD	87.99%	761'760.51	0.61	a)
USD5558XAA66	5.8750 % MUNRE 5 7/8 05/23/42 REGS	400	200	0	600 USD	101.55%	586'104.59	0.47	a)
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	200	200	0	400 USD	88.42%	340'222.48	0.27	a)
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	500	200	0	700 EUR	97.12%	679'840.00	0.54	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52056730679	3.6250 % IFXGR 3 5/8 PERP	200	0	0	200 EUR	99.74%	199'474.00	0.16	a)
X52218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	300	0	0	300 EUR	114.17%	342'504.00	0.27	a)
X52722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	200	200	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	400	300	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52879811987	3.8750 % MRKGR 3 7/8 08/27/54	0	300	0	300 EUR	100.27%	300'798.00	0.24	a)
X52895631567	3.1250 % EOANGR 3 1/8 03/05/30 EMTN	0	450	0	450 EUR	100.84%	453'798.00	0.36	a)
DE							5'223'088.58	4.17	
DK0030393665	3.8750 % NYKRE 3 7/8 07/05/27 EMTN	0	900	300	600 EUR	102.43%	614'592.00	0.49	a)
DK0030523030	3.6250 % NYKRE 3 5/8 07/24/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	101.11%	505'555.00	0.40	a)
DK							1'120'147.00	0.89	
E50813211028	6.0000 % BBVASM 6 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
E50840609053	7.5000 % CABKSM 7 1/2 PERP	200	0	0	200 EUR	110.00%	220'000.00	0.18	a)
U505946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
U505946KAM36	9.3750 % BBVASM 9 3/8 PERP	200	200	0	400 USD	109.03%	419'514.09	0.34	a)
U505946KAN19	7.8830 % BBVASM 7.883 11/15/34	200	400	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
U505946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
U505964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	600	0	200	400 USD	94.98%	365'471.74	0.29	a)
U505964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
U505964HBG92	5.4390 % SANTAN 5.439 07/15/31	0	400	0	400 USD	100.90%	388'254.56	0.31	a)
U505971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	200	0	0	200 USD	85.68%	164'843.60	0.13	a)
U505971KAQ22	9.6250 % SANTAN 9 5/8 PERP _	200	200	0	400 USD	115.10%	442'874.08	0.35	a)
X52300292963	1.2500 % CLNXSM 1 1/4 01/15/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52455392584	2.6250 % SABSM 2 5/8 03/24/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52465792294	2.2500 % CLNXSM 2 1/4 04/12/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52552369469	4.6250 % REESM 4 5/8 PERP	300	0	0	300 EUR	102.75%	308'250.00	0.25	a)
X52580221658	4.8750 % IBESM 4 7/8 PERP EMTN	300	300	0	600 EUR	103.42%	620'544.00	0.50	a)
X52674597468	8.2500 % BBVASM 8 1/4 11/30/33 EMTN	0	200	0	200 GBP	108.57%	259'543.53	0.21	a)
X52726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	200	300	0	500 EUR	108.16%	540'785.00	0.43	a)
X52782109016	4.2500 % SABSM 4 1/4 09/13/30 EMTN	0	900	0	900 EUR	104.07%	936'657.00	0.75	a)
X52826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.87%	203'730.00	0.16	a)
X52949317676	4.2470 % IBESM 4.247 PERP EMTN	0	200	0	200 EUR	101.14%	202'284.00	0.16	a)
ES							5'072'751.60	4.05	
CH1348614228	1.8775 % ACAFP 1.8775 06/07/32 EMTN	0	500	0	500 CHF	104.75%	554'838.73	0.44	a)
FR0013428513	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 06/21/39 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	200	300	0	500 EUR	93.10%	465'520.00	0.37	a)
FR0014002829	1.7950 % BNP 1.795 09/03/27 ENTN	0	600	0	600 AUD	94.78%	341'202.87	0.27	a)
FR0014005EJ6	1.0000 % BNFP 1 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 03/02/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	300	200	400	100 EUR	104.83%	104'830.00	0.08	a)
FR001400KKC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	300	200	0	500 EUR	107.13%	535'625.00	0.43	a)
FR001400KY44	4.1250 % BNP 4 1/8 09/26/32 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L461	6.6250 % SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN	100	100	0	200 GBP	105.79%	252'883.48	0.20	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	105.22%	105'222.00	0.08	a)
FR001400N2U2	6.5000 % ACAFP 6 1/2 PERP EMTN	400	200	0	600 EUR	105.02%	630'144.00	0.50	a)
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	500	0	500 EUR	103.18%	515'920.00	0.41	a)
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	0	100	0	100 EUR	105.02%	105'019.00	0.08	a)
FR001400QOL3	5.1250 % ENGIFP 5 1/8 PERP	0	400	0	400 EUR	103.76%	415'020.00	0.33	a)
FR001400RIX8	4.8750 % CNPFP 4 7/8 07/16/54 EMTN	0	500	0	500 EUR	106.07%	530'350.00	0.42	a)
FR001400SCF6	4.8750 % ACFP 4 7/8 PERP	0	200	0	200 EUR	102.16%	204'314.00	0.16	a)
FR001400SCZ4	3.3750 % SUFP 3 3/8 09/03/36 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400SJS4	3.5000 % AKEFP 3 1/2 09/12/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.78%	99'780.00	0.08	a)
US06675GBC87	5.0880 % BFCM 5.088 01/23/27 REGS	600	500	400	700 USD	100.39%	676'018.06	0.54	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	300	300	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	200	300	0	500 USD	98.48%	473'683.42	0.38	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	200	0	0	200 USD	95.24%	183'236.08	0.15	a)
USF1067PAD80	9.2500 % BNP 9 1/4 PERP REGS	200	200	0	400 USD	107.37%	413'122.89	0.33	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	400	600	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF12033TP59	2.9470 % BNFP 2.947 11/02/26 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF2R125Q730	6.2510 % ACAFP 6.251 01/10/35 REGS	400	550	500	450 USD	101.18%	437'985.45	0.35	a)
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.44%	100'439.00	0.08	a)
XS2610457967	5.5000 % AXASA 5 1/2 07/11/43 EMTN	400	0	0	400 EUR	111.02%	444'064.00	0.35	a)
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	350	200	0	550 EUR	107.26%	589'913.50	0.47	a)
FR							8'179'131.48	6.53	
US06738ECU73	4.9420 % BACR 4.942 09/10/30	0	200	0	200 USD	98.44%	189'390.64	0.15	a)
US404280DV88	6.2540 % HSBC 6.254 03/09/34	400	300	0	700 USD	104.37%	702'770.85	0.56	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	300	0	0	300 USD	96.56%	278'649.02	0.22	a)
US53944YAZ60	5.4620 % LLOYDS 5.462 01/05/28	0	300	0	300 USD	100.89%	291'138.98	0.23	a)
US53944YBA01	5.7210 % LLOYDS 5.721 06/05/30	0	450	0	450 USD	102.00%	441'530.72	0.35	a)
US639057AL28	5.5830 % NWG 5.583 03/01/28	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63906YAJ73	5.4100 % NWG 5.41 05/17/29 144A	0	400	0	400 USD	101.48%	390'455.51	0.31	a)
US92857W8X74	5.1250 % VOD 5 1/8 06/04/2081	400	0	0	400 USD	77.16%	296'880.86	0.24	a)
USG84228FQ64	6.3010 % STANLN 6.301 01/09/29 REGS	400	300	0	700 USD	103.01%	693'660.22	0.55	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	100	0	0	100 GBP	99.86%	119'356.17	0.10	a)
XS1083986718	3.8750 % AVLN 3 7/8 07/03/44 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057092236	2.2500 % SSELN 2 1/4 09/27/35 EMTN	200	0	0	200 GBP	75.59%	180'696.28	0.14	a)
XS2083961370	3.7500 % LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN	200	0	0	200 GBP	92.90%	222'086.13	0.18	a)
XS2113658202	5.7500 % NWIDE 5 3/4 PERP	200	0	0	200 GBP	98.15%	234'631.69	0.19	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	0	500	0	500 USD	91.49%	440'019.98	0.35	a)
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	0	200	0	200 GBP	60.43%	144'470.01	0.12	a)
XS2485268150	6.8750 % AVLN 6 7/8 PERP	200	0	0	200 GBP	99.06%	236'804.69	0.19	a)
XS2592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	200	500	500	200 EUR	107.63%	215'258.00	0.17	a)
XS2641168997	5.7500 % UU 5 3/4 06/26/36 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2678308359	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 09/11/35 EMTN	150	0	150	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	100	300	0	400 GBP	104.64%	500'283.06	0.40	a)
XS2741906809	5.3500 % NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN	300	300	200	400 GBP	96.07%	459'313.95	0.37	a)
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.61%	205'226.00	0.16	a)
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2794589403	5.1250 % BRITEL 5 1/8 10/03/54 EMTN	0	550	0	550 EUR	103.51%	569'316.00	0.45	a)
XS2892335394	5.6250 % BRITEL 5 5/8 12/03/41 EMTN	0	150	0	150 GBP	96.08%	172'267.83	0.14	a)
XS2896922312	7.5000 % NWIDE 7 1/2 PERP	0	500	200	300 GBP	100.98%	362'077.46	0.29	a)
XS2898838516	3.5750 % NWG 3.575 09/12/32 EMTN	0	350	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2902024772	2.8750 % HLNLN 2 7/8 09/18/28 EMTN	0	500	0	500 EUR	100.16%	500'815.00	0.40	a)
XS2902086706	4.6250 % HLNLN 4 5/8 09/18/33 EMTN	0	200	0	200 GBP	95.90%	229'243.41	0.18	a)
XS2991273462	3.8750 % SVTLN 3 7/8 08/04/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.77%	100'766.00	0.08	a)
GB							8'177'108.46	6.53	
XS2904504979	4.0000 % EUROB 4 09/24/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.08%	153'126.00	0.12	a)
GR							153'126.00	0.12	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	300	0	0	300 EUR	91.30%	273'894.00	0.22	a)
HK							273'894.00	0.22	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	600	300	0	900 USD	84.16%	728'602.09	0.58	a)
USG0R4HJAD89	6.6080 % AIB 6.608 09/13/29 REGS	200	700	0	900 USD	104.79%	907'190.03	0.72	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	300	0	0	300 USD	84.92%	245'069.27	0.20	a)
XS2528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	200	200	0	400 GBP	104.73%	500'727.70	0.40	a)
XS2560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	100	300	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2959514519	6.0000 % AIB 6 PERP	0	400	0	400 EUR	100.51%	402'048.00	0.32	a)
IE							2'783'637.09	2.22	
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	400	600	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	200	0	0	200 EUR	96.65%	193'296.00	0.15	a)
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	200	300	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2678939427	9.1250 % ISPIM 9 1/8 PERP	200	200	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2798269069	4.7500 % TRNIM 4 3/4 PERP	0	300	0	300 EUR	102.97%	308'907.00	0.25 a)	
XS2948435743	3.6250 % PRYIM 3 5/8 11/28/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.23%	202'456.00	0.16 a)	
IT							704'659.00	0.56	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	400	0	0	400 USD	58.60%	225'496.47	0.18 a)	
XS2839195877	4.2500 % APTV 4 1/4 06/11/36	0	300	0	300 EUR	100.81%	302'430.00	0.24 a)	
JE							527'926.47	0.42	
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822CY81	5.2420 % MUFG 5.242 04/19/29	0	400	0	400 USD	100.88%	388'166.06	0.31 a)	
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	200	0	0	200 USD	109.03%	209'757.05	0.17 a)	
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	500	0	0	500 USD	102.04%	490'806.13	0.39 a)	
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	400	500	0	900 USD	102.59%	888'169.40	0.71 a)	
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	200	0	0	200 USD	86.73%	166'850.23	0.13 a)	
US874060BL90	5.6500 % TACHEM 5.65 07/05/44	0	1'000	0	1'000 USD	98.73%	949'723.62	0.76 a)	
USJ1121LAA38	6.2000 % DAIL 6.2 PERP REGS	0	600	0	600 USD	101.13%	583'668.93	0.47 a)	
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	100.80%	969'684.08	0.77 a)	
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2892386462	3.5560 % MUFG 3.556 09/05/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.77%	305'316.00	0.24 a)	
JP							4'952'141.50	3.96	
USY555CGAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	200	0	200 USD	99.68%	191'766.66	0.15 a)	
USY8085FBL32	6.5000 % HYUELE 6 1/2 01/17/33 REGS	400	300	0	700 USD	105.68%	711'578.46	0.57 a)	
KR							903'345.12	0.72	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	200	200	0	400 EUR	100.78%	403'124.00	0.32 a)	
LI							403'124.00	0.32	
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	400	0	0	400 EUR	93.11%	372'436.00	0.30 a)	
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	400	0	0	400 EUR	84.32%	337'268.00	0.27 a)	
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.95%	411'808.00	0.33 a)	
LU							1'121'512.00	0.90	
USP01703AD22	3.2500 % ALPEKA 3 1/4 02/25/31 REGS	300	300	0	600 USD	85.16%	491'517.97	0.39 a)	
USP87026AA16	6.0000 % SILAMX 6 11/25/29 REGS	0	800	0	800 USD	100.11%	770'398.82	0.62 a)	
MX							1'261'916.79	1.01	
US21688ABH41	4.4940 % RABOBK 4.494 10/17/29	0	700	0	700 USD	98.87%	665'742.51	0.53 a)	
US456837BF96	6.0830 % INTNED 6.083 09/11/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	1'000	400	600 USD	100.69%	581'169.79	0.46 a)	
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	500	300	500	300 USD	97.53%	281'442.52	0.22 a)	
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1693822634	4.7500 % ABNANV 4 3/4 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	300	0	0	300 EUR	99.38%	298'137.00	0.24 a)	
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	100	0	0	100 EUR	99.97%	99'967.00	0.08 a)	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	300	0	0	300 EUR	84.23%	252'675.00	0.20 a)	
XS2456432413	4.8750 % RABOBK 4 7/8 PERP	400	200	0	600 EUR	99.24%	595'446.00	0.48 a)	
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	400	200	0	600 EUR	108.15%	648'900.00	0.52 a)	
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	200	200	0	400 USD	102.67%	395'053.63	0.32 a)	
XS2590262296	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN	200	200	300	100 GBP	100.96%	120'668.58	0.10 a)	
XS2592804434	7.3750 % TEVA 7 3/8 09/15/29	100	0	0	100 EUR	114.03%	114'025.00	0.09 a)	
XS2646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	400	300	0	700 EUR	111.75%	782'250.00	0.62 a)	
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	200	100	0	300 EUR	104.15%	312'462.00	0.25 a)	
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	100	300	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	100	300	0	400 EUR	107.44%	429'748.00	0.34 a)	
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	105.20%	105'197.00	0.08 a)	
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	100	300	200	200 EUR	103.29%	206'588.00	0.16 a)	
XS2747181969	3.1250 % ABBNVX 3 1/8 01/15/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2764455619	3.8750 % KPN 3 7/8 02/16/36 GMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2774944008	6.8750 % ABNANV 6 7/8 PERP	0	400	0	400 EUR	107.75%	431'000.00	0.34 a)	
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.55%	203'096.00	0.16 a)	
XS2787827604	3.7500 % STLA 3 3/4 03/19/36 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2790191303	6.6250 % ASRNED 6 5/8 PERP	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2809859536	5.6250 % ACHMEA 5 5/8 11/02/44 EMTN	0	300	0	300 EUR	107.34%	322'011.00	0.26	a)
XS2824778075	4.8750 % KPN 4 7/8 PERP	0	300	0	300 EUR	103.25%	309'735.00	0.25	a)
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	103.41%	206'820.00	0.17	a)
XS2886191589	4.2500 % INTNED 4 1/4 08/26/35 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2898290916	3.8750 % DLR 3 7/8 09/13/33	0	300	0	300 EUR	100.94%	302'820.00	0.24	a)
XS2932834604	3.2500 % DSVDC 3 1/4 11/06/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.71%	100'712.00	0.08	a)
XS2969695084	3.2500 % FERSM 3 1/4 01/16/30	0	250	0	250 EUR	100.65%	251'622.50	0.20	a)
NL							8'017'288.53	6.40	
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	200	0	0	200 USD	93.28%	179'463.32	0.14	a)
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
NO							179'463.32	0.14	
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	400	300	0	700 USD	101.81%	685'573.11	0.55	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	0	700	0	700 USD	101.54%	683'761.76	0.55	a)
USQ1269WAA38	5.6980 % BZLNZ 5.698 01/28/35 REGS	0	600	0	600 USD	100.35%	579'178.55	0.46	a)
NZ							1'948'513.42	1.56	
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTEDPZOM0011	4.7500 % EDPPL 4 3/4 05/29/54 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.14%	510'715.00	0.41	a)
PT							510'715.00	0.41	
XS2526881532	4.6250 % TELIAS 4 5/8 12/21/2082	300	0	0	300 EUR	102.42%	307'269.00	0.25	a)
SE							307'269.00	0.25	
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	200	300	0	500 USD	93.80%	451'164.17	0.36	a)
SG							451'164.17	0.36	
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	600	0	0	600 USD	67.54%	389'814.85	0.31	a)
US00206RMT67	5.4000 % T 5.4 02/15/34	300	0	0	300 USD	100.53%	290'117.39	0.23	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	100	400	0	500 USD	93.22%	448'374.51	0.36	a)
US00287YCB39	4.2500 % ABBV 4 1/4 11/21/49	600	0	0	600 USD	81.81%	472'188.55	0.38	a)
US009158BH84	4.6000 % APD 4.6 02/08/29	0	500	0	500 USD	99.82%	480'099.63	0.38	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	400	700	0	1'100 USD	73.38%	776'456.22	0.62	a)
US025816CW76	4.0500 % AXP 4.05 05/03/29	500	0	300	200 USD	97.64%	187'847.67	0.15	a)
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	475	0	475 USD	101.09%	461'920.45	0.37	a)
US025816DY24	5.0850 % AXP 5.085 01/30/31	0	100	0	100 USD	100.32%	96'499.94	0.08	a)
US025816DZ98	5.4420 % AXP 5.442 01/30/36	0	500	0	500 USD	100.11%	481'484.83	0.38	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XCH17	5.4500 % AMT 5.45 02/15/34	0	800	0	800 USD	100.27%	771'660.90	0.62	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	300	0	0	300 USD	95.41%	275'333.18	0.22	a)
US03040WBD65	5.1500 % AWK 5.15 03/01/34	0	400	0	400 USD	99.06%	381'178.46	0.30	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	300	0	0	300 USD	69.84%	201'547.76	0.16	a)
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	500	300	0	800 USD	99.75%	767'613.01	0.61	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	100	0	0	100 USD	96.68%	93'000.36	0.07	a)
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	300	0	0	300 USD	93.04%	268'487.94	0.21	a)
US036752AW30	5.5000 % ELV 5 1/2 10/15/32	100	0	0	100 USD	101.39%	97'530.19	0.08	a)
US036752AZ60	5.3750 % ELV 5 3/8 06/15/34	0	600	0	600 USD	99.53%	574'434.21	0.46	a)
US03740LAF94	5.0000 % AON 5 09/12/32	400	400	0	800 USD	98.50%	757'993.51	0.61	a)
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	200	0	0	200 USD	97.82%	188'203.59	0.15	a)
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	0	500	0	500 USD	100.50%	483'375.07	0.39	a)
US04636NAN30	5.0000 % AZN 5 02/26/34	0	500	0	500 USD	98.87%	475'544.79	0.38	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	200	0	0	200 USD	97.22%	187'035.79	0.15	a)
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	0	200	0	200 USD	90.89%	174'869.04	0.14	a)
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	500	500	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	500	1'000	1'000	500 USD	103.52%	497'910.13	0.40	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	300	0	0	300 USD	86.28%	248'985.37	0.20	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	200	200	0	400 USD	83.88%	322'768.86	0.26	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	400	0	0	400 USD	86.46%	332'676.94	0.27	a)
US110122EJ39	5.5000 % BMY 5 1/2 02/22/44	0	720	720	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EK02	5.5500 % BMY 5.55 02/22/54	0	100	0	100 USD	97.17%	93'469.80	0.07	a)
US110122EL84	5.6500 % BMY 5.65 02/22/64	0	100	0	100 USD	96.40%	92'728.13	0.07	a)
US11135FBR10	4.0000 % AVGO 4 04/15/29 144A	100	0	0	100 USD	96.46%	92'784.89	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US11135FBV22	4.9260 % AVGO 4.926 05/15/37 144A	400	800	0	1'200 USD	94.52%	1'091'093.71	0.87	a)
US126408HV80	4.5000 % CSX 4 1/2 11/15/52	200	0	0	200 USD	84.38%	162'336.76	0.13	a)
US126408HW63	5.2000 % CSX 5.2 11/15/33	0	200	0	200 USD	100.59%	193'530.87	0.15	a)
US126408HY20	4.9000 % CSX 4.9 03/15/55	0	225	0	225 USD	89.59%	193'898.82	0.15	a)
US126650DS68	5.0000 % CVS 5 02/20/26	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	600	0	600 USD	97.20%	561'015.01	0.45	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	200	0	0	200 USD	89.97%	173'093.28	0.14	a)
US126650EH94	7.0000 % CVS 7 03/10/55	0	420	0	420 USD	101.06%	408'281.40	0.33	a)
US14448CBC73	5.9000 % CARR 5.9 03/15/34	0	400	68	332 USD	103.50%	330'558.03	0.26	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	300	400	0	700 USD	95.15%	640'673.13	0.51	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	50	0	0	50 USD	101.95%	49'036.36	0.04	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	200	0	100	100 USD	102.91%	98'996.20	0.08	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967PG03	5.8270 % C 5.827 02/13/35	0	400	0	400 USD	99.32%	382'148.10	0.31	a)
US172967PL97	5.4490 % C 5.449 06/11/35	0	1'000	0	1'000 USD	99.65%	958'583.18	0.77	a)
US17327CAN39	2.0140 % C 2.014 01/25/26	400	400	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	250	0	0	250 USD	54.15%	130'226.39	0.10	a)
US20030NEC11	4.6500 % CMCSA 4.65 02/15/33	700	0	0	700 USD	96.24%	648'059.94	0.52	a)
US22822VBA89	5.0000 % CCI 5 01/11/28	400	0	0	400 USD	100.28%	385'849.69	0.31	a)
US22822VBE02	5.8000 % CCI 5.8 03/01/34	0	300	0	300 USD	101.72%	293'548.66	0.23	a)
US237266AJ06	6.0000 % DAR 6 06/15/30 144A	200	0	0	200 USD	99.55%	191'520.40	0.15	a)
US244199BL82	5.4500 % DE 5.45 01/16/35	0	600	0	600 USD	102.08%	589'163.59	0.47	a)
US244199BM65	5.7000 % DE 5.7 01/19/55	0	400	0	400 USD	102.75%	395'365.30	0.32	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	100	0	0	100 USD	101.24%	97'387.82	0.08	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	400	0	0	400 USD	102.58%	394'707.32	0.32	a)
US24703DBN03	5.4000 % DELL 5.4 04/15/34	0	600	0	600 USD	99.35%	573'389.54	0.46	a)
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	400	300	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	300	0	0	300 USD	92.11%	265'809.87	0.21	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	100	0	0	100 USD	94.05%	90'466.59	0.07	a)
US337738BH05	5.6250 % FI 5 5/8 08/21/33	200	0	0	200 USD	101.71%	195'681.79	0.16	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	400	300	0	700 USD	83.65%	563'256.36	0.45	a)
US36267VAF04	5.6500 % GEHC 5.65 11/15/27	0	400	0	400 USD	102.34%	393'780.00	0.31	a)
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	400	0	0	400 USD	107.24%	412'626.53	0.33	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	500	300	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GB607	4.6920 % GS 4.692 10/23/30	0	140	0	140 USD	98.11%	132'127.68	0.11	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	300	600	0	900 USD	95.67%	828'233.18	0.66	a)
US38145GAH39	3.5000 % GS 3 1/2 11/16/26	500	0	0	500 USD	98.05%	471'615.23	0.38	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	200	0	0	200 USD	96.08%	184'838.69	0.15	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	150	0	0	150 USD	93.53%	134'951.00	0.11	a)
US42824CBP32	5.2500 % HPE 5 1/4 07/01/28	400	200	0	600 USD	101.36%	584'990.65	0.47	a)
US42824CBS70	4.4000 % HPE 4.4 09/25/27	0	100	0	100 USD	99.18%	95'409.09	0.08	a)
US42824CBW82	5.6000 % HPE 5.6 10/15/54	0	300	0	300 USD	96.63%	278'848.14	0.22	a)
US437076AS19	5.8750 % HD 5 7/8 12/16/36	300	0	0	300 USD	105.46%	304'333.08	0.24	a)
US437076DF60	5.3000 % HD 5.3 06/25/54	0	500	0	500 USD	95.24%	458'066.16	0.37	a)
US458140CF51	5.1250 % INTC 5 1/8 02/10/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	400	0	0	400 USD	99.78%	383'921.94	0.31	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	100	0	0	100 USD	91.22%	87'745.23	0.07	a)
US46647PCM68	0.7680 % JPM 0.768 08/09/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	400	500	200	700 USD	100.29%	675'317.76	0.54	a)
US46647PDW32	6.0700 % JPM 6.07 10/22/27	400	400	300	500 USD	102.27%	491'888.32	0.39	a)
US46647PEC68	5.3360 % JPM 5.336 01/23/35	400	400	0	800 USD	99.78%	767'874.66	0.61	a)
US46647PER38	4.9460 % JPM 4.946 10/22/35	0	500	0	500 USD	96.57%	464'496.80	0.37	a)
US478160CE22	2.9500 % JNJ 2.95 03/03/27	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836CA47	5.7500 % K 5 3/4 05/16/54	0	700	0	700 USD	99.00%	666'631.35	0.53	a)
US49447BAB99	4.8500 % KIM 4.85 03/01/35	0	450	0	450 USD	95.00%	411'224.97	0.33	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	500	400	0	900 USD	85.95%	744'073.13	0.59	a)
US532457CL03	4.7000 % LLY 4.7 02/09/34	0	500	0	500 USD	97.01%	466'584.23	0.37	a)
US532457CS55	5.0500 % LLY 5.05 08/14/54	0	500	0	500 USD	92.20%	443'468.57	0.35	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	100	300	0	400 USD	96.10%	369'781.28	0.30	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	300	0	0	300 USD	99.48%	287'075.70	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	500	400	0	900 USD	101.30%	877'044.45	0.70	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	200	0	0	200 USD	75.49%	145'242.91	0.12	a)
US57636QAZ72	4.8750 % MA 4 7/8 05/09/34	0	700	100	600 USD	98.50%	568'523.99	0.45	a)
US58933YBL83	4.9000 % MRK 4.9 05/17/44	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59156RBN70	4.0500 % MET 4.05 03/01/45	600	400	0	1'000 USD	79.84%	768'020.88	0.61	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	0	600	0	600 USD	65.45%	377'751.99	0.30	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	300	0	0	300 USD	83.80%	241'840.00	0.19	a)
US595112CB74	5.8750 % MU 5 7/8 09/15/33	300	0	0	300 USD	102.27%	295'121.45	0.24	a)
US595112CD31	5.3000 % MU 5.3 01/15/31	0	300	0	300 USD	99.88%	288'250.24	0.23	a)
US61690DK726	5.0160 % MS 5.016 01/12/29	0	300	0	300 USD	100.40%	289'730.68	0.23	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	700	0	0	700 USD	100.09%	673'997.96	0.54	a)
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	200	300	0	500 USD	98.28%	472'697.42	0.38	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	400	0	400 USD	101.65%	391'128.87	0.31	a)
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	600	0	0	600 USD	100.97%	582'774.32	0.47	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	250	0	0	250 USD	98.64%	237'216.87	0.19	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	400	300	0	700 USD	100.50%	676'745.29	0.54	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US742718GL74	4.5500 % PG 4.55 10/24/34	0	500	0	500 USD	97.69%	469'845.24	0.38	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	400	0	0	400 USD	88.96%	342'284.90	0.27	a)
US744320BP63	6.5000 % PRU 6 1/2 03/15/54	0	500	0	500 USD	101.75%	489'411.30	0.39	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	200	400	0	600 USD	87.92%	507'470.95	0.41	a)
US747525BT99	6.0000 % QCOM 6 05/20/53	300	0	0	300 USD	104.26%	300'870.06	0.24	a)
US74834LBG41	5.0000 % DGX 5 12/15/34	0	200	0	200 USD	96.91%	186'437.45	0.15	a)
US75884RBA05	3.7000 % REG 3.7 06/15/30	300	0	0	300 USD	93.76%	270'577.30	0.22	a)
US75884RBB87	5.2500 % REG 5 1/4 01/15/34	0	400	0	400 USD	98.70%	379'762.47	0.30	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	400	300	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAL80	2.9000 % CRM 2.9 07/15/51	0	400	0	400 USD	63.66%	244'943.25	0.20	a)
US828807DW40	6.2500 % SPG 6 1/4 01/15/34	0	200	0	200 USD	106.08%	204'085.39	0.16	a)
US828807DX23	6.6500 % SPG 6.65 01/15/54	300	0	0	300 USD	111.00%	320'323.58	0.26	a)
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	400	0	0	400 USD	103.86%	399'628.66	0.32	a)
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	0	300	0	300 USD	106.41%	307'086.18	0.25	a)
US857477CN16	4.5300 % STT 4.53 02/20/29	0	110	0	110 USD	99.26%	105'027.24	0.08	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	400	400	0	800 USD	100.27%	771'668.59	0.62	a)
US863667BM24	5.2000 % SYK 5.2 02/10/35	0	500	0	500 USD	99.52%	478'685.56	0.38	a)
US87264ACV52	5.2000 % TMUS 5.2 01/15/33	100	0	0	100 USD	99.16%	95'382.15	0.08	a)
US87264ACW36	5.6500 % TMUS 5.65 01/15/53	700	500	0	1'200 USD	96.61%	1'115'230.96	0.89	a)
US883556CY62	5.4040 % TMO 5.404 08/10/43	200	0	0	200 USD	98.39%	189'284.83	0.15	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	150	0	0	150 USD	83.29%	120'182.67	0.10	a)
US904764BU02	4.2500 % UNANA 4 1/4 08/12/27	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818GC65	4.9500 % UNP 4.95 09/09/52	300	200	0	500 USD	91.24%	438'827.16	0.35	a)
US91324PEU21	4.2500 % UNH 4 1/4 01/15/29	650	300	700	250 USD	98.19%	236'129.87	0.19	a)
US91324PFC14	5.3750 % UNH 5 3/8 04/15/54	0	600	0	600 USD	93.57%	540'046.43	0.43	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	600	800	0	1'400 USD	69.36%	934'091.93	0.75	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	550	0	0	550 USD	67.79%	358'658.25	0.29	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	200	0	0	200 USD	97.66%	187'893.85	0.15	a)
US928563AL97	2.2000 % VMW 2.2 08/15/31	300	0	0	300 USD	83.25%	240'258.56	0.19	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	100	500	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBR96	2.9500 % WM 2.95 06/01/41	0	1'000	0	1'000 USD	72.75%	699'837.86	0.56	a)
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	300	0	0	300 USD	94.72%	273'353.48	0.22	a)
US95040QAF19	4.9500 % WELL 4.95 09/01/48	300	0	0	300 USD	89.91%	259'461.00	0.21	a)
US95040QAK04	2.7000 % WELL 2.7 02/15/27	0	200	0	200 USD	96.25%	185'173.45	0.15	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	400	300	200	500 USD	101.51%	488'252.15	0.39	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	300	400	0	700 USD	100.61%	677'472.53	0.54	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	500	0	0	500 USD	103.43%	497'472.44	0.40	a)
USU75000CQ78	4.5920 % ROSW 4.592 09/09/34 REGS	0	700	0	700 USD	96.06%	646'800.75	0.52	a)
XS2343510520	0.5000 % K O 1/2 05/20/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	300	200	300	200 EUR	85.73%	171'466.00	0.14	a)
XS2386186576	1.1250 % LLY 1 1/8 09/14/51	100	0	0	100 EUR	61.72%	61'717.00	0.05	a)
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2484340075	2.7500 % PPG 2 3/4 06/01/29	150	200	0	350 EUR	98.80%	345'793.00	0.28	a)
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	100	0	0	100 EUR	104.89%	104'888.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2790333707	3.7900 % MS 3.79 03/21/30	0	500	300	200 EUR	102.94%	205'872.00	0.16	a)
XS2892944732	3.3750 % SYK 3 3/8 09/11/32	0	100	0	100 EUR	100.99%	100'988.00	0.08	a)
XS2894910665	3.6310 % NGGLN 3.631 09/03/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.62%	304'851.00	0.24	a)
XS2909746666	5.2500 % CMCSA 5 1/4 09/26/40	0	200	0	200 GBP	95.71%	228'789.21	0.18	a)
XS2931344217	3.6250 % CARR 3 5/8 01/15/37 REGS	0	300	0	300 EUR	98.88%	296'643.00	0.24	a)
XS2970154436	3.2500 % MET 3 1/4 12/14/32 GMTN	0	300	0	300 EUR	100.11%	300'342.00	0.24	a)
US							55'030'872.41	43.95	
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	500	0	0	500 USD	97.61%	469'474.89	0.37	a)
XS							469'474.89	0.37	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall	04.09.2024	1'315'000	1'115'634	USD/CHF	0.00	0.00
Devisentermingeschäfte						0.00	0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		18'000	20'353	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.05.2024		180'000	169'213	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		190'000	173'157	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 03.05.2024		10'000	11'701	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		11'000	12'486	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.05.2024		192'000	179'879	USD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 03.05.2024		3'000	1'806	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		3'000	3'072	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		290'224	254'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		69'275	116'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		1'845'604	1'892'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		218'126	327'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 03.05.2024		18'000	12'309	CAD/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		4'925'133	5'409'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		36'418'000	33'402'590	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.05.2024		27'086'000	25'332'959	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2024		63'656'000	371'019	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		12'581'000	12'338'816	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 03.05.2024		1'671'000	1'137'454	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2024		2'247'000	1'500'052	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 03.05.2024		47'319'000	281'220	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		358'000	365'027	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 03.05.2024		481'000	292'094	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2024		662'000	394'274	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 03.05.2024		1'216'000	1'423'988	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2024		1'636'000	1'878'881	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		322'725	54'151'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 07.05.2024		295'018	48'041'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 07.05.2024		250'000	1'541	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 07.05.2024		472'000	2'814	JPY/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		55'252	9'505'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		33'061'509	36'177'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.06.2024		25'183'828	26'961'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		370'196	63'448'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		12'156'350	12'424'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.06.2024		1'139'267	1'675'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		1'495'379	2'247'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 04.06.2024		281'895	47'285'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		422'083	413'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 04.06.2024		298'076	491'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		392'042	660'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.06.2024		1'424'740	1'218'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		1'871'290	1'635'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		155'000	158'518	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		66'000	64'546	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		261'000	243'918	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		8'000	9'098	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		10'000	6'820	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		6'000	7'002	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		339'000	308'691	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		12'000	7'974	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		6'000	3'687	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		7'000	4'189	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		412'000	2'482	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		4'000	2'446	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		624'000	3'741	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		221'000	205'376	USD/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		1'716'542	1'901'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		53'066	80'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		25'936	43'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		16'424	2'819'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		16'000	18'638	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		455'740	464'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		31'000	20'939	CAD/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		76'648	67'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		14'000	16'439	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.06.2024		26'479'000	24'389'997	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		66'267'000	380'412	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		258'000	263'427	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.06.2024		46'249'000	271'088	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.06.2024		1'634'000	1'104'256	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		696'000	417'558	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		12'822'000	12'556'585	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.06.2024		1'182'000	1'386'331	GBP/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		1'694'000	1'945'830	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.06.2024		481'000	294'653	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		37'739'000	34'044'352	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		2'315'000	1'532'021	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.07.2024		24'403'999	26'527'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		386'150	67'195'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		330'437	323'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 02.07.2024		275'013	46'777'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		421'943	705'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 02.07.2024		1'378'955	1'177'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		12'711'518	13'006'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		1'937'594	1'692'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 02.07.2024		300'649	491'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		34'263'825	38'105'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		215'433	241'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.07.2024		120'327	131'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		200'840	226'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.07.2024		142'394	155'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.07.2024		1'177'000	1'388'283	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.07.2024		1'620'000	1'104'676	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.07.2024		705'000	423'071	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		38'572'000	34'659'256	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		323'000	335'375	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 02.07.2024		491'000	305'972	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.07.2024		26'813'000	25'019'128	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		2'328'000	1'528'607	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		1'692'000	1'921'926	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 02.07.2024		46'777'000	271'339	JPY/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		13'006'000	12'524'778	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.07.2024		67'195'000	375'345	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 03.07.2024		1'094'020	1'620'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		1'536'568	2'328'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 05.08.2024		1'359'259	1'154'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		35'137'494	39'266'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		398'667	383'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 05.08.2024		24'574'815	26'379'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		1'943'871	1'718'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 05.08.2024		264'266	45'396'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		12'863'033	13'391'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		377'853	67'573'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		23'000	23'956	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		1'718'000	1'942'354	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.08.2024		67'573'000	395'309	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		13'391'000	12'754'928	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		360'000	377'913	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.08.2024		39'266'000	34'562'326	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 05.08.2024		1'154'000	1'369'605	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 05.08.2024		45'396'000	278'910	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 05.08.2024		26'379'000	24'376'473	USD/EUR		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 06.08.2024		1'089'435	1'599'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		427'654	715'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 06.08.2024		298'902	480'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		1'557'524	2'380'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.08.2024		715'000	410'961	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.08.2024		2'380'000	1'516'441	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 06.08.2024		1'599'000	1'069'518	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 06.08.2024		480'000	289'616	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 03.09.2024		1'168'000	1'386'655	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.09.2024		13'277'000	12'467'554	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.09.2024		68'166'000	397'223	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 03.09.2024		483'000	296'046	AUD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.09.2024		39'431'000	33'449'751	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 03.09.2024		45'227'000	280'631	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.09.2024		26'559'000	23'991'653	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.09.2024		728'000	419'053	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.09.2024		1'761'000	1'963'383	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		372'000	396'111	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.09.2024		1'984'404	1'761'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.09.2024		399'121	68'166'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.09.2024		24'505'105	26'559'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 04.09.2024		278'721	45'227'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.09.2024		417'303	728'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		13'118'578	13'803'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		416'610	396'000	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 04.09.2024		1'556'872	2'450'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.09.2024		1'384'679	1'168'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		35'108'231	40'030'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 04.09.2024		291'254	483'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.09.2024		1'086'303	1'625'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.09.2024		528'535	622'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2024		526'000	494'063	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2024		1'221'000	1'035'910	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.09.2024		24'000	25'551	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.09.2024		1'625'000	1'089'220	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2024		2'450'000	1'542'145	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 02.10.2024		1'111'564	1'659'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		439'591	412'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		1'967'405	1'770'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		417'951	728'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.10.2024		24'719'559	27'400'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 02.10.2024		284'585	45'737'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		1'551'578	2'471'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		34'508'482	40'814'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 02.10.2024		299'545	489'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		397'301	68'128'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		12'841'396	13'703'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 02.10.2024		1'408'948	1'188'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.10.2024		130'000	81'166	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		2'866'000	16'891	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		3'241'000	2'728'316	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		183'000	206'545	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.10.2024		14'000	8'169	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		62'000	65'879	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		1'132'000	1'065'358	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.10.2024		12'571'000	11'834'339	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.10.2024		1'188'000	1'427'867	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.10.2024		714'000	417'861	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.10.2024		65'262'000	384'889	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.10.2024		27'400'000	24'549'552	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.10.2024		1'587'000	1'795'786	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 02.10.2024		489'000	303'948	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		350'000	371'747	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.10.2024		2'341'000	1'461'814	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.10.2024		1'659'000	1'100'373	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 02.10.2024		45'737'000	286'487	JPY/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		37'573'000	31'693'201	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		11'831'009	12'598'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.11.2024		1'370'655	1'142'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		405'989	696'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.11.2024		24'820'046	27'740'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		1'750'647	1'553'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 04.11.2024		317'345	511'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.11.2024		447'168	420'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		1'403'898	2'255'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.11.2024		1'092'451	1'648'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		31'694'274	37'717'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		39'000	41'551	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		81'094	72'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		73'254	117'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		709'331	821'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		453'355	483'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.11.2024		442'000	409'240	USD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.11.2024		27'298'000	25'145'542	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.11.2024		696'000	394'180	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.11.2024		38'538'000	33'325'350	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.11.2024		13'081'000	12'280'443	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.11.2024		1'142'000	1'352'424	GBP/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.11.2024		1'648'000	1'088'917	CAD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.11.2024		1'625'000	1'806'610	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.11.2024		2'372'000	1'471'470	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.11.2024		511'000	308'320	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		381'000	405'859	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		375'884	63'690'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 05.11.2024		294'355	46'843'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 05.11.2024		46'843'000	283'274	JPY/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.11.2024		63'690'000	361'530	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 03.12.2024		24'366'861	26'484'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 03.12.2024		282'283	46'564'000	EUR/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 03.12.2024		406'044	719'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.12.2024		32'490'542	37'692'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.12.2024		11'965'699	12'771'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.12.2024		376'373	66'269'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 03.12.2024		1'337'751	1'131'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 03.12.2024		1'096'488	1'660'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.12.2024		1'783'110	1'609'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.12.2024		1'462'503	2'363'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 03.12.2024		304'430	505'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.12.2024		406'652	381'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 03.12.2024		326'000	307'619	USD/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.12.2024		66'269'000	388'721	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.12.2024		719'000	412'634	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.12.2024		12'771'000	11'882'777	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.12.2024		1'609'000	1'801'662	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.12.2024		2'363'000	1'486'776	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.12.2024		37'692'000	33'205'144	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.01.2025		422'503	739'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 06.01.2025		1'096'676	1'622'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2025		11'960'167	12'888'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2025		426'649	396'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.01.2025		1'841'052	1'651'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.01.2025		1'524'010	2'429'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 06.01.2025		304'340	494'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 06.01.2025		1'324'190	1'102'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 06.01.2025		23'932'180	25'314'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.01.2025		33'243'523	37'892'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.01.2025		1'651'000	1'873'984	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.01.2025		2'429'000	1'530'659	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.01.2025		396'000	421'995	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.01.2025		37'892'000	34'341'520	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.01.2025		739'000	414'675	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.01.2025		12'888'000	12'095'388	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 06.01.2025		494'000	295'345	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 06.01.2025		1'622'000	1'089'088	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 06.01.2025		25'314'000	24'444'414	USD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 06.01.2025		1'102'000	1'332'756	GBP/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.01.2025		396'530	67'564'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 08.01.2025		285'505	45'137'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 08.01.2025		45'137'000	277'396	JPY/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.01.2025		67'564'000	389'626	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.02.2025		1'321'170	1'094'000	EUR/GBP		0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.02.2025		23'713'806	24'586'000	EUR/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.02.2025		1'843'576	1'630'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.02.2025		1'523'335	2'423'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.02.2025		1'092'282	1'627'000	EUR/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.02.2025		368'418	345'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.02.2025		33'081'653	36'624'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.02.2025		386'183	66'962'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.02.2025		410'521	734'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/EUR Verfall 04.02.2025		294'406	493'000	EUR/AUD		0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 04.02.2025		276'847	44'952'000	EUR/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.02.2025		11'736'565	12'533'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.02.2025		1'041'290	1'147'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.02.2025		542'403	580'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.02.2025		1'736'253	1'907'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.02.2025		67'941	61'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.02.2025		16'516	2'815'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.02.2025		40'000	26'987	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.02.2025		12'000	7'243	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.02.2025		568'690	606'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.02.2025		54'441	86'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.02.2025		15'292	27'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.02.2025		849'000	5'309	JPY/EUR		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.02.2025		24'000	28'491	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.02.2025		156'131	248'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.02.2025		995'591	1'052'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.02.2025		126'672	112'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.02.2025		2'739'729	3'020'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.02.2025		1'885'000	11'725	JPY/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.02.2025		52'026	92'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.02.2025		42'698'000	38'774'054	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.02.2025		24'586'000	23'649'481	USD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 04.02.2025		42'218'000	262'279	JPY/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 04.02.2025		1'803'000	2'034'433	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.02.2025		1'587'000	1'054'044	CAD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/AUD Verfall 04.02.2025		481'000	288'589	AUD/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.02.2025		345'000	365'447	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.02.2025		69'777'000	409'158	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.02.2025		14'771'000	13'944'563	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.02.2025		1'070'000	1'279'048	GBP/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.02.2025		2'757'000	1'728'722	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.02.2025		853'000	483'156	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2025		38'528'527	42'562'000	CHF/USD		0.00	0.00	b)
	USD/EUR Verfall 04.03.2025		23'748'177	24'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	b)
	JPY/EUR Verfall 04.03.2025		258'577	41'542'000	EUR/JPY		0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.03.2025		2'026'736	1'802'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
	CAD/EUR Verfall 04.03.2025		1'061'881	1'599'000	EUR/CAD		0.00	0.00	b)
	AUD/EUR Verfall 04.03.2025		295'441	493'000	EUR/AUD		0.00	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 04.03.2025		371'436	350'000	EUR/CHF		0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.03.2025		419'420	71'524'000	CHF/JPY		0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.03.2025		13'894'610	14'746'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
	GBP/EUR Verfall 04.03.2025		1'249'854	1'047'000	EUR/GBP		0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.03.2025		1'723'362	2'754'000	CHF/CAD		0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.03.2025		479'981	850'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'851'808.45	3.08
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	119'729'973.67	95.62
Sonstige Vermögenswerte	1'629'324.77	1.30
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	125'211'106.89	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-26'764.94	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	125'184'341.95	

Bewertungskategorien		Kurswert EUR	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	119'729'973.67	95.62
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = EUR	0.60001631
CAD	1 = EUR	0.66421543
CHF	1 = EUR	1.05935796
GBP	1 = EUR	1.19527097
JPY	100 = EUR	0.62121400
USD	1 = EUR	0.96195000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	60'460'352.95	48.297
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	72'897'555.67	58.232

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.01.2025

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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

Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2024 - 31.01.2025

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

Periode: 28.03.2024 - 31.01.2025

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

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

Benchmark

Dieser Fonds 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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2024 / 2025

Ex-Datum: 06.05.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 09.05.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AAH1 EUR	Ja	EUR	3.65000	1.27750	2.37250
BAH1 EUR	Ja	EUR	3.50000	1.22500	2.27500
DAH1 EUR	Ja	EUR	3.55000	1.24250	2.30750

Thesaurierung des Nettoertrags 2024 / 2025

Ex-Datum: 06.05.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 09.05.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CTH1 EUR	Ja	EUR	3.758	1.315	2.443
GTH1 EUR	Ja	EUR	4.536	1.587	2.949
NT CHF	Ja	EUR	4.896	1.713	3.183
NTH1 CHF	Ja	EUR	4.002	1.400	2.602

Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

6 Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

Übersicht

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		781'826'202.11	321'710'046.40	308'648'295.95
Klasse AT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		207'550.03	144'280.20	104'605.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'083.078	1'452.078	1'062.078
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.6362	99.3612	98.4918
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.7060	99.4307	98.6001
Thesaurierung je Anteil		2.57	1.80	0.84
Total Expense Ratio (TER)		0.80 %	0.80 %	0.80 %
Klasse DT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'205'044.49	12'267'613.44	15'515'936.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		133'135.152	124'360.944	158'994.346
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.1853	98.6452	97.5880
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.2547	98.7143	97.6953
Thesaurierung je Anteil		2.96	2.18	1.41
Total Expense Ratio (TER)		0.39 %	0.39 %	0.40 %
Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		768'413'607.59	309'298'152.76	293'027'753.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'251'267.563	3'348'013.504	3'205'825.659
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.1267	92.3826	91.4048
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		93.1919	92.4473	91.5053
Thesaurierung je Anteil		3.13	2.39	2.37
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2024 / 2025	2023 / 2024	2022 / 2023
Klasse AT CHF (Lancierung 08.08.2022)	0.92 %	1.15 %	-1.40 %
Klasse DT CHF (Lancierung 05.05.2022)	1.34 %	1.60 %	-2.30 %
Klasse NT CHF	1.73 %	2.00 %	-6.04 %
Benchmark	1.50 %	1.46 %	-6.43 %
Tracking Error 33)	0.25 %	0.35 %	1.75 %

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	2024 / 2025
Klasse AT CHF (Lancierung 08.08.2022)	-0.58 %
Klasse DT CHF (Lancierung 05.05.2022)	-0.16 %
Klasse NT CHF	0.23 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2025	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	13'083'746.69	4'907'691.03
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	761'398'232.16	312'986'495.12
Derivative Finanzinstrumente	-860'238.55	701'214.42
Sonstige Vermögenswerte	8'218'213.40	3'118'640.70
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	781'839'953.70	321'714'041.27
Andere Verbindlichkeiten	-13'751.59	-3'994.87
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	781'826'202.11	321'710'046.40

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AT CHF	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'452.078	1'062.078
Ausgegebene Anteile		1'021.000	390.000
Zurückgenommene Anteile		-390.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'083.078	1'452.078
Klasse DT CHF	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		124'360.944	158'994.346
Ausgegebene Anteile		57'390.522	109'675.801
Zurückgenommene Anteile		-48'616.314	-144'309.203
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		133'135.152	124'360.944
Klasse NT CHF	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'348'013.504	3'205'825.659
Ausgegebene Anteile		4'903'589.059	364'209.115
Zurückgenommene Anteile		-335.000	-222'021.270
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'251'267.563	3'348'013.504

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		321'710'046.40	308'648'295.95
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'242'803.22	-2'739'553.08
Saldo aus dem Anteilverkehr		445'938'952.55	9'679'586.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		17'420'006.38	6'121'716.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		781'826'202.11	321'710'046.40

Erfolgsrechnung

	von bis	01.02.2024 31.01.2025	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		220'586.80	103'110.08
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		15'693'136.56	7'821'626.09
Erträge aus Wertpapierleihe		73'911.60	43'600.60
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		10'426'081.38	959'493.67
Total Ertrag		26'413'716.34	8'927'830.44
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-26.26
Reglementarische Vergütungen		-56'092.52	-67'890.36
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-67'537.29	-553'154.63
Total Aufwand		-123'629.81	-621'071.25
Nettoertrag / Verlust		26'290'086.53	8'306'759.19
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-41'931'285.65	2'190'935.84
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		330'886.37	58'847.07
Realisierter Erfolg		-15'310'312.75	10'556'542.10
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		32'730'319.13	-4'434'825.36
Gesamterfolg		17'420'006.38	6'121'716.74

Verwendung des Erfolges

Klasse AT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	5'363.81	2'623.85
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'363.81	2'623.85
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'877.33	918.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'486.48	1'705.50
Total	5'363.81	2'623.85
Klasse DT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	394'472.37	272'020.40
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	394'472.37	272'020.40
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	138'065.33	95'207.14
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	256'407.04	176'813.26
Total	394'472.37	272'020.40
Klasse NT CHF	31.01.2025	31.01.2024
Nettoertrag	25'890'250.35	8'032'114.94
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	25'890'250.35	8'032'114.94
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	9'061'587.62	2'811'240.23
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	16'828'662.73	5'220'874.71
Total	25'890'250.35	8'032'114.94

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							761'398'232.16	97.39	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							761'398'232.16	97.39	
AU3CB0291466	5.9060 % ANZ 5.906 08/12/32	2'500	2'000	0	4'500 AUD	102.25%	2'606'054.01	0.33	a)
AU3CB0293769	6.8600 % CBAAU 6.86 11/09/32 MTN	0	5'500	0	5'500 AUD	104.85%	3'266'109.47	0.42	a)
AU3CB0297562	4.9000 % TLSAU 4.9 03/08/28 MTN	1'760	0	0	1'760 AUD	100.92%	1'006'048.32	0.13	a)
AU3CB0306462	5.7400 % NAB 5.74 02/09/34 MTN	0	3'000	0	3'000 AUD	101.80%	1'729'739.98	0.22	a)
AUD							8'607'951.78	1.10	
CA06368LHJ85	7.0570 % BMO 7.057 PERP	1'000	2'000	0	3'000 CAD	105.78%	1'989'772.20	0.25	a)
CA06369ZCF95	2.0770 % BMO 2.077 06/17/30	3'000	0	0	3'000 CAD	99.54%	1'872'304.11	0.24	a)
CA06415FFT45	1.8500 % BNS 1.85 11/02/26	1'200	0	0	1'200 CAD	97.81%	735'920.21	0.09	a)
CA06415FRB09	3.7000 % BNS 3.7 07/27/2081 1	0	7'500	0	7'500 CAD	91.10%	4'283'917.49	0.55	a)
CA07813ZCA09	3.8000 % BCECN 3.8 08/21/28 MTN	2'000	1'000	0	3'000 CAD	100.52%	1'890'681.42	0.24	a)
CA13607HC349	2.2500 % CM 2 1/4 01/07/27	1'600	0	0	1'600 CAD	98.20%	985'119.35	0.13	a)
CA13607PBA18	4.9000 % CM 4.9 06/12/34	0	3'000	0	3'000 CAD	103.66%	1'949'876.31	0.25	a)
CA31430WU444	5.2790 % CCDJ 5.279 05/15/34	0	2'000	0	2'000 CAD	105.08%	1'317'711.75	0.17	a)
CA775109BU44	3.1000 % RCICN 3.1 04/15/25	800	0	0	800 CAD	99.96%	501'387.81	0.06	a)
CA7800863G73	5.0960 % RY 5.096 04/03/34	0	2'000	0	2'000 CAD	104.58%	1'311'466.85	0.17	a)
CA780086RA47	2.7400 % RY 2.74 07/25/29	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA780086TQ70	3.6500 % RY 3.65 11/24/2081	0	6'000	0	6'000 CAD	90.81%	3'416'261.85	0.44	a)
CA87971MBJ14	3.3000 % TCN 3.3 05/02/29 CY	0	1'000	0	1'000 CAD	98.61%	618'295.37	0.08	a)
CA87971MBQ56	2.3500 % TCN 2.35 01/27/28 CAC	1'000	0	0	1'000 CAD	97.03%	608'344.91	0.08	a)
CA89117FM630	3.6000 % TD 3.6 10/31/2081 1	0	2'000	0	2'000 CAD	90.62%	1'136'333.74	0.15	a)
CA89117FWS42	3.1050 % TD 3.105 04/22/30 MTN	2'000	0	0	2'000 CAD	99.93%	1'253'143.48	0.16	a)
CA89117FYZ66	1.1280 % TD 1.128 12/09/25	2'300	0	0	2'300 CAD	98.48%	1'420'132.51	0.18	a)
CA92660FAR51	4.6500 % QBRN 4.65 07/15/29	0	2'500	0	2'500 CAD	103.22%	1'617'937.25	0.21	a)
CAD							26'908'606.61	3.44	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.13	a)
CH0406990801	2.6250 % SLHNVX 2 5/8 09/25/48	0	3'000	0	3'000 CHF	104.15%	3'124'500.00	0.40	a)
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	2'000	0	0	2'000 CHF	100.20%	2'004'000.00	0.26	a)
CH0579132959	1.7500 % HELNSW 1 3/4 PERP	0	2'000	0	2'000 CHF	100.85%	2'017'000.00	0.26	a)
CHF							8'158'000.00	1.04	
BE0002950310	4.5000 % KCB BB 4 1/2 06/06/26 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6301510028	1.1500 % ABIBB 1.15 01/22/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	97.32%	918'622.44	0.12	a)
BE6350791073	3.8750 % SOLBBB 3 7/8 04/03/28	0	1'000	0	1'000 EUR	102.10%	963'762.99	0.12	a)
BE6355213644	3.2500 % LONNVX 3 1/4 09/04/30	0	2'500	0	2'500 EUR	100.56%	2'373'064.70	0.30	a)
CH0494734418	0.6500 % UBS 0.65 09/10/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	90.09%	1'700'822.63	0.22	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	100.09%	2'834'565.93	0.36	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	0	3'000	0	3'000 EUR	100.78%	2'854'021.11	0.37	a)
DE000A2DAHN6	3.0990 % ALVGR 3.099 07/06/47	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2GSCW3	1.5000 % MBGGR 1 1/2 07/03/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	94.61%	893'069.23	0.11	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	104.12%	4'914'344.50	0.63	a)
DE000A383QQ2	3.1250 % AMPRIO 3 1/8 08/27/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	100.06%	2'833'489.81	0.36	a)
DE000A3L69X8	3.3750 % TRAGR 3 3/8 01/14/28 EMTN	0	3'500	0	3'500 EUR	100.33%	3'314'823.80	0.42	a)
DE000A4DFCB7	3.2500 % EVKGR 3 1/4 01/15/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.08%	286'254.51	0.04	a)
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45YE5	4.8750 % CMZB 4 7/8 10/16/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	104.34%	1'969'853.50	0.25	a)
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	2'500	1'500	0	4'000 EUR	100.76%	3'804'379.75	0.49	a)
DK0030393665	3.8750 % NYKRE 3 7/8 07/05/27 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	2'000	0	0	2'000 EUR	105.27%	1'987'373.55	0.25	a)
ES0344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	1'500	0	0	1'500 EUR	103.47%	1'465'085.50	0.19	a)
FR0012199123	3.8750 % SCOR 3 7/8 PERP	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013312154	2.6250 % ACAFP 2 5/8 01/29/48	0	1'500	0	1'500 EUR	97.28%	1'377'494.71	0.18	a)
FR0013425162	1.8750 % BFCM 1 7/8 06/18/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	93.70%	3'537'954.23	0.45	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013476611	1.1250 % BNP 1 1/8 01/15/32 EMTN	2'000	3'000	0	5'000 EUR	95.95%	4'528'780.78	0.58	a)
FR0013478252	1.5000 % AKEFP 1 1/2 PERP	1'500	0	0	1'500 EUR	97.92%	1'386'443.53	0.18	a)
FR0013508512	1.0000 % ACAFP 1 04/22/26 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140005L7	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	93.64%	2'209'829.04	0.28	a)
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	2'500	3'000	1'500	4'000 EUR	93.10%	3'515'487.79	0.45	a)
FR0014002557	0.0100 % BFCM 0.01 05/11/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	96.65%	1'824'671.23	0.23	a)
FR0014003B55	1.3750 % ORAFP 1 3/8 PERP EMTN	0	3'500	0	3'500 EUR	90.51%	2'990'249.85	0.38	a)
FR0014005EJ6	1.0000 % BNFP 1 PERP	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.80%	904'283.57	0.12	a)
FR0014007VJ6	1.7500 % BPCEGP 1 3/4 02/02/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	93.17%	1'759'027.69	0.22	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	2'400	0	0	2'400 EUR	105.08%	2'380'589.07	0.30	a)
FR001400F0H3	5.0000 % DECFP 5 01/11/29	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	103.05%	972'759.00	0.12	a)
FR001400KDS4	5.5000 % ACAFP 5 1/2 08/28/33 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	106.60%	2'012'445.34	0.26	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	105.22%	1'986'523.98	0.25	a)
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	103.18%	2'435'059.80	0.31	a)
FR001400SCY7	3.0000 % SUPP 3 09/03/30 EMTN	0	1'300	0	1'300 EUR	100.62%	1'234'717.67	0.16	a)
FR001400TSJ2	2.7500 % MCFP 2 3/4 11/07/27 EMTN	0	4'400	0	4'400 EUR	100.31%	4'166'417.90	0.53	a)
FR001400U1Q3	3.6250 % SOCGEN 3 5/8 11/13/30	0	1'600	0	1'600 EUR	100.89%	1'523'715.35	0.19	a)
FR001400WRE9	4.2500 % RCFFP 4 1/4 01/21/30 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	100.41%	1'516'510.99	0.19	a)
IT0005631822	3.3000 % UCGIM 3.3 07/16/29 EMTN	0	3'050	0	3'050 EUR	100.44%	2'891'684.02	0.37	a)
XS1069539291	2.3750 % DGELN 2 3/8 05/20/26 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1109836038	3.3750 % HANRUE 3 3/8 PERP	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1197833053	1.1250 % KO 1 1/8 03/09/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550951138	2.3180 % TELEFO 2.318 10/17/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550988643	4.6250 % NNGRNV 4 5/8 01/13/48 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	103.55%	3'909'990.89	0.50	a)
XS1602547264	1.7760 % BAC 1.776 05/04/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	98.81%	1'399'130.46	0.18	a)
XS1799611642	3.2500 % AXASA 3 1/4 05/28/49 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	99.30%	1'874'626.01	0.24	a)
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	0	1'000	0	1'000 EUR	99.28%	937'124.21	0.12	a)
XS1883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1891174341	2.5000 % DLR 2 1/2 01/16/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1951220596	3.7500 % CABKSM 3 3/4 02/15/29 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1960678255	1.1250 % MDT 1 1/8 03/07/27	1'500	1'000	0	2'500 EUR	96.90%	2'286'786.03	0.29	a)
XS2000719992	3.5000 % ENELIM 3 1/2 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010039035	0.9500 % DBHNGR 0.95 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	0	2'500	0	2'500 EUR	89.63%	2'115'078.26	0.27	a)
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	0	1'000	0	1'000 EUR	97.12%	916'781.70	0.12	a)
XS2021467753	0.9000 % STANLN 0.9 07/02/27 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2027364327	1.6250 % LOGICR 1 5/8 07/15/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	96.09%	1'360'574.09	0.17	a)
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	0	3'000	0	3'000 EUR	93.23%	2'640'099.09	0.34	a)
XS2053052895	0.3750 % EDPPL 0 3/8 09/16/26 EMTN	1'500	1'500	0	3'000 EUR	96.38%	2'729'332.38	0.35	a)
XS2063232727	0.5000 % C 0 1/2 10/08/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	96.48%	910'711.99	0.12	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	0	2'500	0	2'500 EUR	90.32%	2'131'526.90	0.27	a)
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.40%	900'554.89	0.12	a)
XS2126058168	0.3910 % SANUK 0.391 02/28/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2176783319	1.2500 % ENIIM 1 1/4 05/18/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	1'000	1'000	0	2'000 EUR	101.26%	1'911'648.44	0.24	a)
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	0	5'000	0	5'000 EUR	98.63%	4'655'130.89	0.60	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2235987224	0.3750 % MDLZ 0 3/8 09/22/29 REGS	0	1'000	0	1'000 EUR	88.77%	837'979.26	0.11	a)
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	0	1'500	0	1'500 EUR	97.39%	1'379'009.78	0.18	a)
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	1'000	0	0	1'000 EUR	98.26%	927'552.38	0.12	a)
XS2244941147	2.2500 % IBESM 2 1/4 PERP NC8	0	1'000	0	1'000 EUR	94.05%	887'792.45	0.11	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	3'500	0	0	3'500 EUR	94.92%	3'135'885.23	0.40	a)
XS22953535413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	1'500	1'000	0	2'500 EUR	96.25%	2'271'422.95	0.29	a)
XS2306517876	0.2500 % DNBNO 0 1/4 02/23/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	92.20%	1'740'620.32	0.22	a)
XS2312744217	1.3750 % ENELIM 1 3/8 PERP 65Y	0	1'000	0	1'000 EUR	94.42%	891'294.57	0.11	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	1'000	2'000	0	3'000 EUR	96.88%	2'743'605.18	0.35	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2337061670	0.5000 % CCEP 0 1/2 09/06/29	0	2'000	0	2'000 EUR	89.59%	1'691'382.95	0.22	a)
XS2338643740	0.4060 % MS 0.406 10/29/27	1'000	0	0	1'000 EUR	96.11%	907'200.43	0.12	a)
XS2343459074	0.6250 % NDAFH 0 5/8 08/18/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	96.58%	911'637.08	0.12	a)
XS2346206902	0.4500 % AMT 0.45 01/15/27	500	0	0	500 EUR	95.52%	450'843.83	0.06	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	3'000	0	500	2'500 EUR	94.99%	2'241'664.36	0.29	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	2'000	500	0	2'500 EUR	91.30%	2'154'559.72	0.28	a)
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	88.47%	1'670'332.46	0.21	a)
XS2375844144	0.3340 % BDX 0.334 08/13/28	0	4'000	0	4'000 EUR	91.55%	3'456'659.71	0.44	a)
XS2381272207	1.3750 % ENBW 1 3/8 08/31/2081	0	4'500	0	4'500 EUR	91.88%	3'902'717.62	0.50	a)
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'500	500	0	1'500 EUR	91.35%	1'293'472.12	0.17	a)
XS2403444677	0.5000 % NDAFH 0 1/2 11/02/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	91.71%	1'731'350.55	0.22	a)
XS2431318711	0.6250 % LOGICR 0 5/8 11/17/25 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	95.83%	904'595.08	0.12	a)
XS2433211310	0.7500 % SRGIM 0 3/4 06/20/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	90.86%	2'144'176.07	0.27	a)
XS2436807866	0.8750 % PTHREE 0 7/8 01/26/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2465792294	2.2500 % CLNXSM 2 1/4 04/12/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	99.31%	1'406'224.38	0.18	a)
XS2488626610	3.1000 % DUK 3.1 06/15/28	500	0	0	500 EUR	100.22%	473'041.23	0.06	a)
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	4'000	2'000	0	6'000 EUR	102.12%	5'784'107.16	0.74	a)
XS2527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	1'000	0	0	1'000 EUR	100.14%	945'280.10	0.12	a)
XS2528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	102.93%	1'360'276.74	0.17	a)
XS2545759099	5.2500 % ISPIM 5 1/4 01/13/30 EMTN	0	1'800	800	1'000 EUR	109.88%	1'037'250.90	0.13	a)
XS2555420103	5.8500 % UCGIM 5.85 11/15/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2558022591	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/33 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	104.60%	2'962'086.56	0.38	a)
XS2558395278	4.0490 % ENBW 4.049 11/22/29 EMTN	1'500	0	500	1'000 EUR	104.67%	988'022.97	0.13	a)
XS2558978883	6.2500 % CABKSM 6 1/4 02/23/33 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	107.43%	2'028'228.48	0.26	a)
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	103.68%	1'468'087.32	0.19	a)
XS2560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	107.30%	1'012'849.32	0.13	a)
XS2582404724	5.7500 % ZFFNGR 5 3/4 08/03/26 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2583203950	5.2500 % SABSM 5 1/4 02/07/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	106.04%	1'501'432.99	0.19	a)
XS2588885025	4.4500 % UCGIM 4.45 02/16/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	104.00%	1'472'533.41	0.19	a)
XS2592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	102.61%	1'065'476.48	0.14	a)
XS2626699982	5.7500 % SANTAN 5 3/4 08/23/33 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	106.75%	2'519'167.35	0.32	a)
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	107.14%	1'011'348.41	0.13	a)
XS2667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	106.59%	2'012'426.46	0.26	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRNE3 3 5/8 12/12/28	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715940891	4.2200 % SDZSW 4.22 04/17/30	2'400	0	0	2'400 EUR	104.71%	2'372'297.26	0.30	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	103.29%	2'047'630.80	0.26	a)
XS2745725155	3.8750 % VW 3 7/8 10/11/28 EMTN	1'300	0	0	1'300 EUR	102.34%	1'255'812.52	0.16	a)
XS2750308483	4.7500 % ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN	1'400	600	0	2'000 EUR	104.07%	1'964'812.71	0.25	a)
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2769892519	3.0000 % SIEGR 3 11/22/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	101.59%	958'967.63	0.12	a)
XS2770512064	4.7500 % ENELIM 4 3/4 PERP	0	1'500	0	1'500 EUR	102.39%	1'449'793.22	0.19	a)
XS2776511060	3.5000 % BKNG 3 1/2 03/01/29	0	1'800	0	1'800 EUR	102.30%	1'738'222.64	0.22	a)
XS2779881601	3.7500 % AALLN 3 3/4 06/15/29	0	3'500	500	3'000 EUR	102.09%	2'891'119.05	0.37	a)
XS2782109016	4.2500 % SABSM 4 1/4 09/13/30 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	101.55%	2'204'735.39	0.28	a)
XS2787827190	3.5000 % STLA 3 1/2 09/19/30 EMTN	0	1'450	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	101.87%	2'403'932.46	0.31	a)
XS2830466137	3.9000 % AMT 3.9 05/16/30	0	1'000	0	1'000 EUR	102.95%	971'815.04	0.12	a)
XS2833390920	3.1250 % DGELN 3 1/8 02/28/31	0	1'900	0	1'900 EUR	100.60%	1'804'300.40	0.23	a)
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.95%	485'916.96	0.06	a)
XS2872909697	3.1210 % AZN 3.121 08/05/30 EMTN	0	1'300	0	1'300 EUR	100.99%	1'239'356.33	0.16	a)
XS2886191589	4.2500 % INTNED 4 1/4 08/26/35 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	102.27%	2'896'273.12	0.37	a)
XS2888621922	3.1250 % NAB 3 1/8 02/28/30 EMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	101.21%	2'197'310.14	0.28	a)
XS2892967949	3.4670 % CCDJ 3.467 09/05/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	102.03%	1'444'639.16	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52895631567	3.1250 % EOANGR 3 1/8 03/05/30 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	100.84%	2'379'837.67	0.30	a)
X52900306171	3.1250 % DTRGR 3 1/8 03/23/28 EMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	100.73%	2'186'867.02	0.28	a)
X52900391777	3.2500 % SDZSW 3 1/4 09/12/29	0	4'500	0	4'500 EUR	100.59%	4'272'748.35	0.55	a)
X52908093805	3.8300 % HBRLN 3.83 10/03/29	0	5'000	0	5'000 EUR	100.75%	4'755'238.70	0.61	a)
X52908177145	3.2500 % NTGYSM 3 1/4 10/02/30 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	99.98%	1'132'501.04	0.14	a)
X52911681083	3.0000 % WURTH 3 08/28/31	0	1'750	0	1'750 EUR	100.42%	1'658'948.21	0.21	a)
X52919101498	3.0000 % INFLN 3 10/23/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	100.17%	945'563.29	0.12	a)
X52932834604	3.2500 % DSVDC 3 1/4 11/06/30 EMTN	0	3'350	0	3'350 EUR	100.71%	3'184'808.26	0.41	a)
X52948435743	3.6250 % PRYIM 3 5/8 11/28/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	101.23%	1'911'119.81	0.24	a)
X52969695084	3.2500 % FERSM 3 1/4 01/16/30	0	2'000	0	2'000 EUR	100.65%	1'900'188.66	0.24	a)
X52978779176	3.5000 % EDPLP 3 1/2 07/21/31 EMTN	0	1'700	0	1'700 EUR	101.02%	1'621'146.07	0.21	a)
EUR							232'546'771.99	29.74	
X50097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	0	3'000	0	3'000 GBP	104.18%	3'526'211.86	0.45	a)
X50138717441	6.1250 % AVLN 6 1/8 11/14/36	1'000	300	1'300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51134541561	5.4530 % AXASA 5.453 PERP EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	1'000	500	0	1'500 GBP	96.90%	1'640'031.23	0.21	a)
X51716248197	2.2560 % HSBC 2.256 11/13/26 DIP	2'000	0	0	2'000 GBP	97.91%	2'209'364.53	0.28	a)
X51961843171	3.0000 % HSBC 3 07/22/28	0	1'000	0	1'000 GBP	95.37%	1'076'057.35	0.14	a)
X52172960481	3.6220 % NWG 3.622 08/14/30	700	0	0	700 GBP	99.47%	785'614.39	0.10	a)
X52195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	200	0	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52355631693	2.5000 % VATFAL 2 1/2 06/29/2083	0	3'500	0	3'500 GBP	89.42%	3'531'272.27	0.45	a)
X52449910921	3.6190 % NWG 3.619 03/29/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 GBP	96.14%	2'169'490.49	0.28	a)
X52528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	1'400	600	0	2'000 GBP	104.73%	2'363'354.57	0.30	a)
X52591847970	6.6250 % LLOYDS 6 5/8 06/02/33 EMTN	0	2'500	0	2'500 GBP	103.23%	2'911'769.23	0.37	a)
X52711945878	7.0900 % BACR 7.09 11/06/29	1'300	1'700	0	3'000 GBP	106.49%	3'604'470.57	0.46	a)
X52729188644	5.3750 % PACLIF 5 3/8 11/30/28 EMTN	1'000	1'500	0	2'500 GBP	102.04%	2'878'315.21	0.37	a)
GBP							26'695'951.70	3.41	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	94.86%	1'292'023.48	0.17	a)
US00084EAE86	6.3390 % ABNANV 6.339 09/18/27 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	102.26%	2'321'520.63	0.30	a)
US00206RHHJ41	4.3500 % T 4.35 03/01/29	0	7'000	0	7'000 USD	98.10%	6'235'579.35	0.80	a)
US00206RMP46	5.5390 % T 5.539 02/20/26	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	1'800	0	0	1'800 USD	99.74%	1'630'305.71	0.21	a)
US00287YDS54	4.8000 % ABBV 4.8 03/15/29	0	2'000	0	2'000 USD	100.17%	1'819'096.57	0.23	a)
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	1'200	0	0	1'200 USD	96.00%	1'046'084.50	0.13	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MBL81	4.6250 % AER 4 5/8 09/10/29	0	1'000	0	1'000 USD	97.88%	888'835.66	0.11	a)
US00774MBN48	4.8750 % AER 4 7/8 04/01/28	0	4'000	0	4'000 USD	99.82%	3'625'771.01	0.46	a)
US01400EAB92	3.0000 % ALC5W 3 09/23/29 144A	0	2'000	0	2'000 USD	91.76%	1'666'398.88	0.21	a)
US02209SBH58	2.3500 % MO 2.35 05/06/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.36%	902'193.08	0.12	a)
US023135BX34	1.0000 % AMZN 1 05/12/26	1'500	0	0	1'500 USD	96.03%	1'308'014.24	0.17	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DY24	5.0850 % AXP 5.085 01/30/31	0	5'000	0	5'000 USD	100.32%	4'554'642.59	0.58	a)
US02665WDZ14	1.3000 % HNDA 1.3 09/09/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	94.94%	862'066.35	0.11	a)
US029163AD49	7.4500 % MUNRE 7.45 12/15/26 B	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAW02	3.8000 % AMT 3.8 08/15/29	0	3'000	0	3'000 USD	94.84%	2'583'447.65	0.33	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	1'000	2'000	0	3'000 USD	83.97%	2'287'387.03	0.29	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	1'000	0	0	1'000 USD	90.82%	824'718.25	0.11	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.33%	874'751.81	0.11	a)
US031162DP23	5.1500 % AMGN 5.15 03/02/28	0	3'500	0	3'500 USD	101.15%	3'214'565.10	0.41	a)
US03522AAG58	3.6500 % ABIBB 3.65 02/01/26	500	0	0	500 USD	99.21%	450'420.04	0.06	a)
US035240AQ30	4.7500 % ABIBB 4 3/4 01/23/29	0	5'000	0	5'000 USD	100.12%	4'545'607.50	0.58	a)
US036752BB83	4.7500 % ELV 4 3/4 02/15/30	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EH93	1.4000 % AAPL 1.4 08/05/28	0	5'000	0	5'000 USD	90.09%	4'090'265.82	0.52	a)
US046353AV09	0.7000 % AZN 0.7 04/08/26	400 4	0	0	400 USD	95.82%	348'041.04	0.04	a)
US052528AL09	2.9500 % ANZ 2.95 07/22/30 144A	00 2'0	600	0	1'000 USD	98.88%	897'879.84	0.11	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	00	0	0	2'000 USD	97.22%	1'765'557.94	0.23	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	1'500	0	0	1'500 USD	99.54%	1'355'741.35	0.17	a)
US05578AAP30	1.0000 % BPCEGP 1 01/20/26 144A	1'500	0	0	1'500 USD	96.69%	1'317'017.56	0.17	a)
US05578BAV80	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/14/25 REGS	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US05581LAF67	5.3350 % BNP 5.335 06/12/29 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	100.90%	1'374'333.68	0.18	a)
US05634WAA09	5.5500 % BACARD 5.55 02/01/30 144A	0	2'500	0	2'500 USD	101.05%	2'293'984.01	0.29	a)
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	2'400	1'000	1'400	2'000 USD	100.53%	1'825'743.49	0.23	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	1'400	0	1'400 USD	101.14%	1'285'749.77	0.16	a)
US05964HAL96	1.8490 % SANTAN 1.849 03/25/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	0	2'000	0	2'000 USD	94.98%	1'724'968.10	0.22	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HBF10	5.3650 % SANTAN 5.365 07/15/28	0	800	0	800 USD	100.79%	732'149.82	0.09	a)
US05964HBJ32	5.5650 % SANTAN 5.565 01/17/30	0	2'000	0	2'000 USD	101.33%	1'840'290.45	0.24	a)
US05971KAA79	5.1790 % SANTAN 5.179 11/19/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHQ55	3.9740 % BAC 3.974 02/07/30 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	96.23%	1'747'651.19	0.22	a)
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	3'500	0	0	3'500 USD	98.52%	3'131'265.14	0.40	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	0	3'000	0	3'000 USD	91.25%	2'485'705.15	0.32	a)
US06051GKW86	4.9480 % BAC 4.948 07/22/28 MTN	1'000	1'000	0	2'000 USD	100.27%	1'821'057.95	0.23	a)
US06368LQ586	7.7000 % BMO 7.7 05/26/2084	0	2'000	0	2'000 USD	103.81%	1'885'202.61	0.24	a)
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.31%	901'811.70	0.12	a)
US06407F2E11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	300	700	0	1'000 USD	95.55%	867'605.45	0.11	a)
US064159VJ25	4.9000 % BNS 4.9 PERP	1'200	0	0	1'200 USD	99.66%	1'085'922.47	0.14	a)
US06738ECU73	4.9420 % BACR 4.942 09/10/30	0	2'500	0	2'500 USD	98.44%	2'234'733.75	0.29	a)
US09659W2N34	1.3230 % BNP 1.323 01/13/27 144A	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09659W2Z63	5.2830 % BNP 5.283 11/19/30 144A	0	1'500	0	1'500 USD	99.68%	1'357'689.12	0.17	a)
US110122DN59	0.7500 % BMY 0 3/4 11/13/25	1'200	0	0	1'200 USD	97.20%	1'059'138.62	0.14	a)
US11135FBE07	1.9500 % AVGO 1.95 02/15/28 144A	0	3'000	0	3'000 USD	91.97%	2'505'400.76	0.32	a)
US11135FBX87	5.0500 % AVGO 5.05 07/12/29	0	3'000	0	3'000 USD	100.41%	2'735'373.50	0.35	a)
US125523AG54	4.1250 % CI 4 1/8 11/15/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CU24	2.8750 % CVS 2 7/8 06/01/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650EC08	5.5500 % CVS 5.55 06/01/31	0	3'000	0	3'000 USD	100.29%	2'732'131.76	0.35	a)
US12704PAA66	5.2000 % CRHID 5.2 05/21/29	0	3'000	500	2'500 USD	100.68%	2'285'493.75	0.29	a)
US134429BG35	4.1500 % CPB 4.15 03/15/28	0	2'000	0	2'000 USD	98.09%	1'781'394.33	0.23	a)
US14913R2H93	0.8000 % CAT 0.8 11/13/25 MTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14913UAAU43	4.7000 % CAT 4.7 11/15/29	0	3'000	0	3'000 USD	99.89%	2'721'235.16	0.35	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	2'000	0	0	2'000 USD	90.54%	1'644'224.30	0.21	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.24%	901'157.90	0.12	a)
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	0	5'000	0	5'000 USD	95.84%	4'351'511.81	0.56	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	3'500	0	0	3'500 USD	95.62%	3'039'034.50	0.39	a)
US191098AM46	5.2500 % COKE 5 1/4 06/01/29	0	3'000	0	3'000 USD	101.27%	2'758'637.74	0.35	a)
US191216DD90	1.0000 % KO 1 03/15/28	0	2'000	0	2'000 USD	90.11%	1'636'542.19	0.21	a)
US19123MAF05	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 144A	1'000	1'500	0	2'500 USD	93.83%	2'130'058.29	0.27	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	1'000	0	0	1'000 USD	103.19%	936'989.55	0.12	a)
US20030NBW02	2.3500 % CMCSA 2.35 01/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	95.87%	1'741'131.39	0.22	a)
US2027A0HR32	4.5000 % CBAAU 4 1/2 12/09/25 144A	400	0	0	400 USD	99.63%	361'876.09	0.05	a)
US21684AAF30	3.7500 % RABOBK 3 3/4 07/21/26 BKNT	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	1'700	0	0	1'700 USD	102.90%	1'588'405.55	0.20	a)
US225313AK19	4.0000 % ACAFP 4 01/10/33 144A	0	3'000	0	3'000 USD	95.14%	2'591'620.10	0.33	a)
US225401AF50	3.8690 % UBS 3.869 01/12/29 144A	2'000	2'000	0	4'000 USD	96.85%	3'517'713.06	0.45	a)
US22822VAC54	3.7000 % CCI 3.7 06/15/26	400	0	0	400 USD	98.59%	358'084.07	0.05	a)
US22822VBA89	5.0000 % CCI 5 01/11/28	1'500	1'500	0	3'000 USD	100.28%	2'731'723.14	0.35	a)
US23329PAF71	1.1270 % DNBNO 1.127 09/16/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	97.77%	887'791.40	0.11	a)
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	96.65%	877'648.49	0.11	a)
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EVK27	0.7000 % DE 0.7 01/15/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	96.67%	877'839.18	0.11	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	1'500	0	0	1'500 USD	100.46%	1'368'340.55	0.18	a)
US24422EXH79	4.5000 % DE 4 1/2 01/16/29	0	3'000	0	3'000 USD	99.31%	2'705'462.33	0.35	a)
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	3'000	4'000	0	7'000 USD	100.96%	6'417'180.27	0.82	a)
US251526BN89	4.8750 % DB 4 7/8 12/01/32	0	2'000	0	2'000 USD	97.22%	1'765'576.10	0.23	a)
US251526CB33	3.9610 % DB 3.961 11/26/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CW79	5.4140 % DB 5.414 05/10/29	0	1'500	0	1'500 USD	101.60%	1'383'800.10	0.18	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	1'500	0	0	1'500 USD	97.57%	1'328'922.09	0.17	a)
US26138EAS81	3.4000 % KDP 3.4 11/15/25	2'500	1'000	0	3'500 USD	99.11%	3'149'952.81	0.40	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US26441CBE49	3.4000 % DUK 3.4 06/15/29	0	4'000	0	4'000 USD	93.91%	3'410'817.41	0.44	a)
US26441CBP95	3.2500 % DUK 3 1/4 01/15/2082	0	2'000	0	2'000 USD	94.21%	1'711'002.29	0.22	a)
US278642AX15	1.4000 % EBAY 1.4 05/10/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NAW56	6.2500 % ENBCN 6 1/4 03/01/2078	0	4'000	0	4'000 USD	98.82%	3'589'340.04	0.46	a)
US29250NBH70	1.6000 % ENBCN 1.6 10/04/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBX21	6.0000 % ENBCN 6 11/15/28	2'000	0	0	2'000 USD	103.48%	1'879'300.28	0.24	a)
US29278GAF54	3.5000 % ENELIM 3 1/2 04/06/28 144A	1'000	0	0	1'000 USD	95.71%	869'058.33	0.11	a)
US29444UBK16	1.0000 % EQIX 1 09/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.71%	887'291.98	0.11	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	90.61%	822'756.86	0.11	a)
US29446MAJ18	1.7500 % EQNR 1 3/4 01/22/26	3'200	0	0	3'200 USD	97.61%	2'836'370.45	0.36	a)
US31429KAD54	2.0500 % CCDJ 2.05 02/10/25 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	400	1'600	0	2'000 USD	100.84%	1'831'355.24	0.23	a)
US31620MBR60	1.1500 % FIS 1.15 03/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.33%	874'706.40	0.11	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	0	4'000	0	4'000 USD	94.05%	3'415'902.49	0.44	a)
US341081FZ53	2.8500 % NEE 2.85 04/01/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.74%	905'652.75	0.12	a)
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	1'000	1'000	0	2'000 USD	103.78%	1'884'748.58	0.24	a)
US35671DCE31	4.1250 % FCX 4 1/8 03/01/28	2'000	0	0	2'000 USD	97.26%	1'766'248.06	0.23	a)
US36264FAL58	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/24/29	0	8'000	0	8'000 USD	94.33%	6'852'435.88	0.88	a)
US36266GAA58	4.8000 % GEHC 4.8 08/14/29	0	3'500	0	3'500 USD	99.41%	3'159'264.86	0.40	a)
US37045XCX21	2.7500 % GM 2 3/4 06/20/25	2'500	0	0	2'500 USD	99.22%	2'252'349.92	0.29	a)
US37045XDP87	2.4000 % GM 2.4 10/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	90.96%	825'953.20	0.11	a)
US375558BF95	3.6500 % GILD 3.65 03/01/26	300	0	0	300 USD	99.13%	270'044.99	0.03	a)
US375558CB72	4.8000 % GILD 4.8 11/15/29	0	1'640	0	1'640 USD	99.74%	1'485'270.51	0.19	a)
US377372AM97	3.6250 % GSK 3 5/8 05/15/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GWZ35	4.2230 % GS 4.223 05/01/29	0	4'000	0	4'000 USD	97.76%	3'550'838.72	0.45	a)
US38141GXM13	1.0930 % GS 1.093 12/09/26 VAR	4'000	0	0	4'000 USD	96.92%	3'520'400.88	0.45	a)
US40049JAV98	6.6250 % TELVIS 6 5/8 03/18/25	1'000	1'000	0	2'000 USD	100.06%	1'817'225.98	0.23	a)
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	1'000	2'000	0	3'000 USD	98.22%	2'675'523.92	0.34	a)
US42824CBS70	4.4000 % HPE 4.4 09/25/27	0	3'500	0	3'500 USD	99.18%	3'152'209.31	0.40	a)
US437076BM30	3.0000 % HD 3 04/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	98.45%	893'966.14	0.11	a)
US44891CCB72	5.5000 % HYNMTR 5 1/2 03/30/26 REGS	650	0	0	650 USD	100.74%	594'612.03	0.08	a)
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	101.77%	924'113.40	0.12	a)
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	3'000	0	3'000 USD	100.69%	2'743'028.36	0.35	a)
US45687VAD82	5.1760 % IR 5.176 06/15/29	0	1'000	0	1'000 USD	100.91%	916'286.01	0.12	a)
US458140BP43	3.4000 % INTC 3.4 03/25/25	800	0	0	800 USD	99.77%	724'761.92	0.09	a)
US458140BY59	3.7500 % INTC 3 3/4 08/05/27	0	2'000	0	2'000 USD	97.27%	1'766'538.63	0.23	a)
US459200KA85	3.5000 % IBM 3 1/2 05/15/29	0	2'500	0	2'500 USD	94.97%	2'155'960.41	0.28	a)
US46647PAR73	4.0050 % JPM 4.005 04/23/29	5'000	2'000	0	7'000 USD	97.41%	6'191'593.41	0.79	a)
US46647PBD78	3.7020 % JPM 3.702 05/06/30	0	7'000	0	7'000 USD	94.97%	6'036'879.85	0.77	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	84.16%	764'196.72	0.10	a)
US48241FAB04	5.7960 % KBCBB 5.796 01/19/29 144A	0	5'000	0	5'000 USD	102.23%	4'641'361.37	0.59	a)
US487836BU10	3.4000 % K 3.4 11/15/27	0	1'000	0	1'000 USD	96.64%	877'521.36	0.11	a)
US49177JAB89	5.5000 % KVUE 5 1/2 03/22/25	2'000	0	0	2'000 USD	100.08%	1'817'625.52	0.23	a)
US49271VAP58	3.9500 % KDP 3.95 04/15/29	0	2'000	0	2'000 USD	96.23%	1'747'614.87	0.22	a)
US49456BAZ40	5.1000 % KMI 5.1 08/01/29	0	1'500	0	1'500 USD	100.11%	1'363'573.28	0.17	a)
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	2'000	4'000	1'000	5'000 USD	98.23%	4'460'023.78	0.57	a)
US539439AQ24	3.5740 % LLOYDS 3.574 11/07/28	1'500	1'000	0	2'500 USD	96.23%	2'184'563.99	0.28	a)
US539439AV19	2.4380 % LLOYDS 2.438 02/05/26	0	2'000	0	2'000 USD	100.00%	1'816'100.00	0.23	a)
US55608JAR95	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 144A	2'000	1'000	0	3'000 USD	96.77%	2'636'159.96	0.34	a)
US55903VBA08	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US56501RAC07	4.1500 % MFCCN 4.15 03/04/26	1'000	0	0	1'000 USD	99.54%	903'836.65	0.12	a)
US571748BY71	4.5500 % MMC 4.55 11/08/27	0	3'330	0	3'330 USD	99.83%	3'018'756.74	0.39	a)
US57629WDE75	1.2000 % MASSMU 1.2 07/16/26 144A	2'500	0	0	2'500 USD	95.36%	2'164'700.40	0.28	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'000	1'000	0	2'000 USD	101.30%	1'839'781.94	0.24	a)
US577081BD37	5.8750 % MAT 5 7/8 12/15/27 144A	1'500	0	0	1'500 USD	100.44%	1'368'108.99	0.17	a)
US58013MEY66	3.7000 % MCD 3.7 01/30/26 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.27%	901'439.40	0.12	a)
US59217GBY44	3.4500 % MET 3.45 12/18/26 144A	2'500	0	0	2'500 USD	97.95%	2'223'519.33	0.28	a)
US59217GFR56	4.8500 % MET 4.85 01/08/29 144A	0	4'000	0	4'000 USD	100.00%	3'632'018.39	0.46	a)
US594918BJ27	3.1250 % MSFT 3 1/8 11/03/25	0	2'500	0	2'500 USD	99.11%	2'249'852.78	0.29	a)
US595112BP79	4.1850 % MU 4.185 02/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	98.72%	896'426.96	0.11	a)
US606822BM52	3.1950 % MUFU 3.195 07/18/29	0	2'000	0	2'000 USD	92.99%	1'688'864.03	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US606822BW35	0.9530 % MUFG 0.953 07/19/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YAD13	3.4770 % MIZUHO 3.477 04/12/26 144A	800	700	0	1'500 USD	98.68%	1'344'041.13	0.17	a)
US61747YFQ35	5.6560 % MS 5.656 04/18/30	0	6'000	0	6'000 USD	101.99%	5'556'830.14	0.71	a)
US61772BAB99	1.5930 % MS 1.593 05/04/27	3'500	500	0	4'000 USD	96.16%	3'492'578.23	0.45	a)
US628530BK28	4.5500 % VTRS 4.55 04/15/28	2'000	2'000	0	4'000 USD	98.22%	3'567'619.48	0.46	a)
US62854AAN46	3.9500 % VTRS 3.95 06/15/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954WAC91	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 144A	1'000	0	0	1'000 USD	96.12%	872'799.50	0.11	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6325C0EB33	1.8870 % NAB 1.887 01/12/27 144A	1'000	0	0	1'000 USD	95.21%	864'509.00	0.11	a)
US63859UBH59	1.5000 % NWDI 1 1/2 10/13/26 144A	500	0	0	500 USD	94.94%	431'064.96	0.06	a)
US641062AE42	3.5000 % NESNVX 3 1/2 09/24/25 144A	1'000	0	0	1'000 USD	99.37%	902'302.04	0.12	a)
US641062AF17	3.6250 % NESNVX 3 5/8 09/24/28 144A	0	2'000	0	2'000 USD	96.65%	1'755'333.29	0.22	a)
US64110LAS51	4.8750 % NFLX 4 7/8 04/15/28	0	3'000	0	3'000 USD	100.54%	2'738'724.20	0.35	a)
US64952WDW01	0.8500 % NYLIFE 0.85 01/15/26 144A	3'000	0	0	3'000 USD	96.74%	2'635'369.95	0.34	a)
US64952WEY57	4.8500 % NYLIFE 4.85 01/09/28 144A	0	1'000	0	1'000 USD	100.42%	911'818.41	0.12	a)
US64952WFF59	4.7000 % NYLIFE 4.7 01/29/29 144A	0	3'000	0	3'000 USD	99.72%	2'716'576.86	0.35	a)
US65163LAN91	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26 144A	0	1'050	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65163LAQ23	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26	0	1'050	0	1'050 USD	100.98%	962'834.47	0.12	a)
US65339KBP49	6.0510 % NEE 6.051 03/01/25	1'600	0	0	1'600 USD	100.09%	1'454'245.71	0.19	a)
US65535HBR93	5.5940 % NOMURA 5.594 07/02/27	0	1'000	0	1'000 USD	101.47%	921'362.01	0.12	a)
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	95.41%	1'732'813.65	0.22	a)
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	2'000	0	0	2'000 USD	100.23%	1'820'258.87	0.23	a)
US674599DC69	5.5500 % OXY 5.55 03/15/26	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XCC74	1.6500 % ORCL 1.65 03/25/26	2'000	1'000	0	3'000 USD	96.64%	2'632'673.04	0.34	a)
US68389XCD57	2.3000 % ORCL 2.3 03/25/28	0	1'000	0	1'000 USD	92.77%	842'370.74	0.11	a)
US6944PL2D07	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 144A	0	2'000	0	2'000 USD	91.08%	1'654'103.88	0.21	a)
US6944PL2E89	1.3750 % PACLIF 1 3/8 04/14/26 144A	500	0	0	500 USD	96.32%	437'307.80	0.06	a)
US713448EQ79	2.2500 % PEP 2 1/4 03/19/25	1'500	0	0	1'500 USD	99.73%	1'358'411.02	0.17	a)
US716973AC67	4.4500 % PFE 4.45 05/19/28	0	2'000	0	2'000 USD	99.52%	1'807'310.08	0.23	a)
US717081DV27	2.7500 % PFE 2 3/4 06/03/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LAU35	3.0000 % PFG 3 04/18/26 144A	400	0	0	400 USD	98.03%	356'060.93	0.05	a)
US74256LFA26	4.6000 % PFG 4.6 08/19/27 144A	0	1'500	0	1'500 USD	99.78%	1'359'078.44	0.17	a)
US745867AX94	5.0000 % PHM 5 01/15/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LBE92	4.6000 % DGX 4.6 12/15/27	0	4'000	0	4'000 USD	99.81%	3'625'153.53	0.46	a)
US74977RDS04	5.5640 % RABOBK 5.564 02/28/29 144A	0	3'000	0	3'000 USD	101.64%	2'768'907.78	0.35	a)
US758750AD59	6.0500 % RRX 6.05 04/15/28 144A	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US758750AM58	6.0500 % RRX 6.05 04/15/28	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US771196BV36	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 144A	2'000	1'000	0	3'000 USD	95.89%	2'612'132.95	0.33	a)
US780097BK63	4.2690 % NWG 4.269 03/22/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EZM29	0.8750 % RY 0 7/8 01/20/26 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	96.67%	1'316'690.66	0.17	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	4'000	6'000	0	10'000 USD	85.44%	7'758'106.79	0.99	a)
US808513BY05	2.4500 % SCHW 2.45 03/03/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.67%	868'722.35	0.11	a)
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	2'000	0	0	2'000 USD	89.41%	1'623'738.69	0.21	a)
US822582BD31	3.2500 % RDSALN 3 1/4 05/11/25	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US822582BT82	2.8750 % RDSALN 2 7/8 05/10/26	0	1'500	0	1'500 USD	98.11%	1'336'290.92	0.17	a)
US82481LAD10	3.2000 % TACHEM 3.2 09/23/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82655AAC71	4.1250 % SIGMA 4 1/8 05/02/26 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	2'200	800	0	3'000 USD	100.44%	2'736'027.29	0.35	a)
US855244BE89	4.7500 % SBUX 4 3/4 02/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	100.25%	1'820'712.89	0.23	a)
US857477CN16	4.5300 % STT 4.53 02/20/29	0	1'000	0	1'000 USD	99.26%	901'294.11	0.12	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	2'500	0	1'000	1'500 USD	100.27%	1'365'807.09	0.17	a)
US863667BE08	4.2500 % SYK 4 1/4 09/11/29	0	3'000	0	3'000 USD	97.62%	2'659'233.51	0.34	a)
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	1'500	0	0	1'500 USD	98.69%	1'344'177.33	0.17	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	750	0	0	750 USD	102.59%	698'669.56	0.09	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	1'500	0	0	1'500 USD	97.97%	1'334'397.64	0.17	a)
US87264ABR59	2.2500 % TMUS 2 1/4 02/15/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABS33	2.6250 % TMUS 2 5/8 02/15/29	0	8'000	0	8'000 USD	91.40%	6'639'806.89	0.85	a)
US87264ADA07	4.8000 % TMUS 4.8 07/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	99.79%	906'124.93	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	0	5'000	0	5'000 USD	86.73%	3'937'531.81	0.50	a)
US87938WAT09	4.1030 % TELEFO 4.103 03/08/27	1'500	0	0	1'500 USD	98.60%	1'342'965.09	0.17	a)
US883556DA77	5.0000 % TMO 5 01/31/29	0	3'000	0	3'000 USD	101.08%	2'753'516.34	0.35	a)
US89116CQJ98	5.1460 % TD 5.146 09/10/34	0	2'000	0	2'000 USD	98.09%	1'781'430.65	0.23	a)
US89236TJK25	1.1250 % TOYOTA 1 1/8 06/18/26 MTN	2'000	0	0	2'000 USD	95.62%	1'736'627.46	0.22	a)
US89236TMK87	4.5500 % TOYOTA 4.55 08/09/29	0	1'500	0	1'500 USD	99.10%	1'349'829.95	0.17	a)
US90353TAN00	4.3000 % UBER 4.3 01/15/30	0	4'000	0	4'000 USD	97.16%	3'529'081.84	0.45	a)
US904764AY33	2.9000 % UNANA 2.9 05/05/27	1'000	0	0	1'000 USD	96.69%	877'975.38	0.11	a)
US91324PEC23	1.1500 % UNH 1.15 05/15/26	1'500	0	0	1'500 USD	95.86%	1'305'739.58	0.17	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	0	7'000	0	7'000 USD	98.63%	6'269'395.13	0.80	a)
US92343VGG32	1.4500 % VZ 1.45 03/20/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAD82	2.7000 % VTRS 2.7 06/22/30	0	6'000	0	6'000 USD	87.12%	4'746'613.44	0.61	a)
US928563AJ42	1.4000 % VMW 1.4 08/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	95.07%	1'726'620.75	0.22	a)
US94106LCC19	4.6500 % WM 4.65 03/15/30	0	8'000	0	8'000 USD	99.14%	7'201'635.58	0.92	a)
US95000U3G61	6.3030 % WFC 6.303 10/23/29	1'000	3'000	0	4'000 USD	104.31%	3'788'856.79	0.48	a)
US961214CX95	2.8500 % WSTP 2.85 05/13/26	500	0	0	500 USD	98.12%	445'480.25	0.06	a)
US961214EF61	4.1100 % WSTP 4.11 07/24/34	0	4'000	0	4'000 USD	94.41%	3'429'268.99	0.44	a)
US961214EM13	2.8940 % WSTP 2.894 02/04/30	1'500	0	0	1'500 USD	100.00%	1'362'075.00	0.17	a)
US96950FAQ72	3.9000 % WMB 3.9 01/15/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	1'500	0	0	1'500 USD	101.51%	1'382'683.19	0.18	a)
US98978VAU70	5.4000 % ZTS 5.4 11/14/25	1'000	0	0	1'000 USD	100.57%	913'216.80	0.12	a)
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	100.63%	1'370'587.97	0.18	a)
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	101.92%	925'520.88	0.12	a)
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	97.37%	884'141.04	0.11	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	100.08%	908'812.76	0.12	a)
USG91139AC27	0.7500 % TAISEM 0 3/4 09/28/25 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAJ36	4.2390 % NTT 4.239 07/25/25 REGS	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAM64	5.1100 % NTT 5.11 07/02/29 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	100.89%	1'832'208.81	0.23	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	400	600	0	1'000 USD	101.55%	922'124.78	0.12	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	99.34%	902'029.63	0.12	a)
USP87026AA16	6.0000 % SILAMX 6 11/25/29 REGS	0	6'500	0	6'500 USD	100.11%	5'908'758.53	0.76	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	101.54%	5'532'421.75	0.71	a)
USQ1269WAA38	5.6980 % BZLNZ 5.698 01/28/35 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	100.35%	6'378'470.10	0.82	a)
USU09513KD07	4.6500 % BMW 4.65 08/13/29 REGS	0	2'500	0	2'500 USD	98.53%	2'236'640.66	0.29	a)
USU74079AT84	3.6250 % NFLX 3 5/8 06/15/25 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	99.49%	1'806'910.53	0.23	a)
USU8344PAE98	5.6500 % SYENS 5.65 06/04/29 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	101.83%	3'698'487.65	0.47	a)
USY3815NBG52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY52758AC63	3.2500 % LGCHM 3 1/4 10/15/24 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY555CGAL65	5.3750 % LGESO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	99.68%	1'267'151.09	0.16	a)
USY8085FBA76	1.5000 % HYUE1 1 1/2 01/19/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	96.83%	2'637'876.17	0.34	a)
XS1385999492	5.6250 % ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN	2'000	1'000	2'000	1'000 USD	100.12%	909'139.66	0.12	a)
XS1423777215	5.6250 % SRENVX 5 5/8 08/15/52	0	2'000	0	2'000 USD	100.05%	1'816'935.41	0.23	a)
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 USD	99.69%	3'620'831.21	0.46	a)
XS1795323952	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 06/01/48	0	5'000	0	5'000 USD	98.69%	4'480'908.93	0.57	a)
XS2046591413	2.3750 % STSP 2 3/8 08/28/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 USD	90.50%	1'643'606.82	0.21	a)
XS2078692014	3.5160 % STANLN 3.516 02/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.93%	907'405.28	0.12	a)
XS2369276014	1.5000 % CONAMP 1 1/2 09/09/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

USD							458'480'950.08	58.64
------------	--	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Derivative Finanzinstrumente							-860'238.55	-0.11
-------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--------------------	--------------

Futures							0.00	0.00
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	120	120	0 EUR	0.00	0.00	0.00
09/24	EURO-BOBL FUTURE SEP24	0	170	170	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/24	EURO-BOBL FUTURE DEC24	0	170	170	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/24	US 5YR NOTE (CBT) DEC24	0	350	350	0 USD	0.00	0.00	0.00
03/25	EURO-BOBL FUTURE MAR25	0	0	250	-250 EUR	0.00	0.00	0.00 a)
03/25	US 5YR NOTE (CBT) MAR25	0	0	450	-450 USD	0.00	0.00	0.00 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Devisentermingeschäfte									
	AUD/CHF Verfall 22.02.2024		2'839'450	5'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		10'196'724	12'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 22.02.2024		2'163'442	2'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		8'385'795	9'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 22.02.2024		1'269'602	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		172'429'056	201'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 22.02.2024		8'462'696	7'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		90'726'331	97'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 22.02.2024		9'347'274	14'700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		5'614'788	6'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		1'865'278	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		1'721'992	2'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.03.2024		10'630'681	16'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.03.2024		10'865'652	9'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.03.2024		2'594'615	4'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		187'380'147	213'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		106'898'175	112'500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		2'638'770	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		1'902'586	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		1'757'450	2'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		1'917'696	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		14'029'712	16'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		9'596'680	10'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		1'921'912	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.05.2024		2'598'066	4'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.05.2024		10'633'598	16'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.05.2024		123'146'368	128'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.05.2024		11'227'000	10'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.05.2024		205'081'040	232'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		1'000'000	959'119	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		3'000'000	2'931'897	EUR/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 20.06.2024		2'690'568	4'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 20.06.2024		10'915'707	16'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.06.2024		117'224'520	120'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 20.06.2024		11'354'340	10'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.06.2024		206'187'924	228'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 20.06.2024		1'000'000	976'757	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.06.2024		1'000'000	901'309	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 20.06.2024		1'000'000	980'562	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.07.2024		10'656'756	16'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.07.2024		11'249'700	10'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.07.2024		2'645'933	4'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		204'693'951	231'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		113'328'698	119'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		2'704'764	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 29.08.2024		2'645'240	4'500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		11'461'180	10'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 29.08.2024		10'763'684	16'700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		207'430'470	234'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		114'926'868	119'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		3'424'820	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 29.08.2024		2'214'928	2'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 29.08.2024		1'712'703	3'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 29.08.2024		1'887'495	3'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		14'682'730	17'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		2'840'742	3'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		6'656'391	7'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		942'621	1'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		12'835'635	15'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		2'841'153	3'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.09.2024		4'349'830	7'600'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		13'099'221	20'900'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 26.09.2024		14'830'338	13'300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		223'441'110	265'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		120'691'968	128'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		938'669	1'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		4'689'035	5'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		1'252'382	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		16'937'740	20'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		3'406'572	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		438'966	700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		1'880'580	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		7'530'936	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 26.09.2024		2'233'824	2'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.09.2024		572'215	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		10'997'285	13'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		622'635	1'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.10.2024		4'968'736	8'600'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		269'844'333	319'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.10.2024		16'404'108	26'200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.10.2024		17'283'752	15'300'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		144'982'684	154'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.10.2024		580'089	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		7'532'936	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.10.2024		812'964	1'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		16'015'803	19'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		9'371'240	10'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.10.2024		2'248'904	2'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		11'018'995	13'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.10.2024		1'258'480	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.10.2024		575'886	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		13'682'432	16'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		8'453'691	9'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.10.2024		1'246'666	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.10.2024		7'509'968	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2024		12'910'140	15'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.11.2024		19'664'694	31'500'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		19'634'475	17'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		176'841'819	189'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		329'444'822	382'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		6'110'571	10'600'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		577'136	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		7'470'832	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		1'119'262	1'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		9'496'762	11'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		568'228	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		1'126'412	1'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		13'010'715	15'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.11.2024		1'247'644	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		10'303'579	11'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		565'525	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		1'668'453	1'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		28'499'295	33'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.11.2024		1'862'067	3'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		8'445'195	9'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		3'758'972	4'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.11.2024		1'121'417	1'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.11.2024		1'245'124	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.11.2024		4'704'110	5'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2024		17'257'960	20'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.11.2024		572'234	1'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 19.12.2024		8'348'397	14'600'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 19.12.2024		209'333'700	225'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 19.12.2024		24'317'919	38'700'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 19.12.2024		23'369'724	21'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.12.2024		402'325'891	457'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.01.2025		24'419'031	39'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 23.01.2025		8'325'771	14'700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.01.2025		23'788'422	21'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		211'948'450	226'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.01.2025		408'138'474	457'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.01.2025		1'000'000	892'580	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 23.01.2025		3'000'000	2'814'003	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.01.2025		8'186'193	9'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 23.01.2025		1'122'617	1'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		3'750'436	4'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.01.2025		3'642'328	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		3'756'104	4'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		1'868'560	2'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.01.2025		11'827'322	13'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 23.01.2025		1'270'326	2'000'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 23.01.2025		5'639'532	6'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.02.2025		436'807'680	482'000'000	CHF/USD		73'206.33	0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 20.02.2025		224'708'995	239'000'000	CHF/EUR		-603'382.19	-0.08	b)
	GBP/CHF Verfall 20.02.2025		24'441'186	22'000'000	CHF/GBP		-323'642.19	-0.04	b)
	CAD/CHF Verfall 20.02.2025		25'778'873	41'000'000	CHF/CAD		108'539.45	0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 20.02.2025		8'360'698	14'800'000	CHF/AUD		-4'311.89	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2025	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 20.02.2025		629'887	1'000'000	CHF/CAD		3'781.06	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 20.02.2025		566'434	1'000'000	CHF/AUD		1'230.34	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 20.02.2025		2'226'566	2'000'000	CHF/GBP		-24'782.99	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 20.02.2025		3'770'080	4'000'000	CHF/EUR		-840.38	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 20.02.2025		9'051'110	10'000'000	CHF/USD		-9'768.84	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 20.02.2025		6'597'528	7'000'000	CHF/EUR		-1'582.63	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 20.02.2025		627'689	1'000'000	CHF/CAD		1'583.52	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 20.02.2025		18'947'565	21'000'000	CHF/USD		-80'268.14	-0.01	b)
Devisentermingeschäfte							-860'238.55	-0.11	

Vermögensaufstellung							Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht							13'083'746.69	1.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							761'398'232.16	97.39
Derivative Finanzinstrumente							-860'238.55	-0.11
Sonstige Vermögenswerte							8'218'213.40	1.05
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode							781'839'953.70	100.00
Andere Verbindlichkeiten							-13'751.59	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode							781'826'202.11	

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);						761'398'232.16	97.39
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;						-860'238.55	-0.11
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	71'688'681.98	9.17
------------------------------	----------------------	-------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							71'688'681.98	9.17
DE000A383QQ2	3.1250 % AMPRIO 3 1/8 08/27/30 EMTN	1'200	EUR	100.06%			1'133'395.92	0.14
DE000A4DFCB7	3.2500 % EVKGR 3 1/4 01/15/30 EMTN	300	EUR	101.08%			286'254.51	0.04
FR0013476611	1.1250 % BNP 1 1/8 01/15/32 EMTN	5'000	EUR	95.95%			4'528'780.78	0.58
FR00140005L7	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	1'500	EUR	93.64%			1'325'897.42	0.17
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	4'000	EUR	93.10%			3'515'487.79	0.45
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	2'000	EUR	105.22%			1'986'523.98	0.25
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	1'000	EUR	103.18%			974'023.92	0.12
FR001400WRE9	4.2500 % RCFFP 4 1/4 01/21/30 EMTN	1'600	EUR	100.41%			1'516'510.99	0.19
US00206RHJ41	4.3500 % T 4.35 03/01/29	7'000	USD	98.10%			6'235'579.35	0.80
US05581LAF67	5.3350 % BNP 5.335 06/12/29 REGS	1'400	USD	100.90%			1'282'711.43	0.16
US05964HBJ32	5.5650 % SANTAN 5.565 01/17/30	2'000	USD	101.33%			1'840'290.45	0.24
US09659W2Z63	5.2830 % BNP 5.283 11/19/30 144A	1'500	USD	99.68%			1'357'689.12	0.17
US19123MAF05	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 144A	400	USD	93.83%			340'809.33	0.04
US225401AF50	3.8690 % UBS 3.869 01/12/29 144A	1'000	USD	96.85%			879'428.26	0.11
US36266GAA58	4.8000 % GEHC 4.8 08/14/29	1'000	USD	99.41%			902'647.10	0.12
US40049JAV98	6.6250 % TELVIS 6 5/8 03/18/25	601	USD	100.06%			546'076.41	0.07
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	2'000	USD	100.69%			1'828'685.57	0.23
US46647PBD78	3.7020 % JPM 3.702 05/06/30	100	USD	94.97%			86'241.14	0.01
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	1'500	USD	98.23%			1'338'007.13	0.17
US595112BP79	4.1850 % MU 4.185 02/15/27	1'000	USD	98.72%			896'426.96	0.11
US65535HBR93	5.5940 % NOMURA 5.594 07/02/27	500	USD	101.47%			460'681.01	0.06
US6944PL2D07	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 144A	2'000	USD	91.08%			1'654'103.88	0.21
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	3'000	USD	100.44%			2'736'027.29	0.35
US855244BE89	4.7500 % SBUX 4 3/4 02/15/26	1'100	USD	100.25%			1'001'392.09	0.13
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	200	USD	102.59%			186'311.88	0.02
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	3'000	USD	86.73%			2'362'519.09	0.30
US89116CQJ98	5.1460 % TD 5.146 09/10/34	1'000	USD	98.09%			890'715.33	0.11
US89236TMK87	4.5500 % TOYOTA 4.55 08/09/29	1'000	USD	99.10%			899'886.63	0.12
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	1'300	USD	100.63%			1'187'842.91	0.15

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2025	Wäh- rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USJ5539RAM64	5.1100 % NTT 5.11 07/02/29 REGS	500	USD	100.89%	458'052.20	0.06	
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	1'000	USD	101.55%	922'124.78	0.12	
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	1'000	USD	99.34%	902'029.63	0.12	
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZNZ 5.898 07/10/34 REGS	2'000	USD	101.54%	1'844'140.58	0.24	
USQ1269WAA38	5.6980 % BZLNZ 5.698 01/28/35 REGS	7'000	USD	100.35%	6'378'470.10	0.82	
XS0097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	938	GBP	104.18%	1'102'528.91	0.14	
XS1423777215	5.6250 % SRENVX 5 5/8 08/15/52	2'000	USD	100.05%	1'816'935.41	0.23	
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	500	GBP	96.90%	546'677.08	0.07	
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	1'000	USD	99.69%	905'207.80	0.12	
XS2053052895	0.3750 % EDPPL 0 3/8 09/16/26 EMTN	2'200	EUR	96.38%	2'001'510.41	0.26	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	2'500	EUR	90.32%	2'131'526.90	0.27	
XS2295335413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	1'000	EUR	96.25%	908'569.18	0.12	
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	1'950	EUR	88.47%	1'628'574.15	0.21	
XS2381272207	1.3750 % ENBW 1 3/8 08/31/2081	1'800	EUR	91.88%	1'561'087.05	0.20	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'500	EUR	91.35%	1'293'472.12	0.17	
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	600	EUR	102.12%	578'410.72	0.07	
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	2'100	EUR	103.29%	2'047'630.80	0.26	
XS2826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	500	EUR	101.87%	480'786.49	0.06	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56639619
CAD	1 = CHF	0.62699810
EUR	1 = CHF	0.94396798
GBP	1 = CHF	1.12829753
USD	1 = CHF	0.90805000

Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	14'967'045.95	19.463
Bond	CHF	61'934'834.49	80.537
Total	CHF	76'901'880.44	100.000

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	830'497'301.33	106.225

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.01.2025

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
NT 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	71'688'681.98
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: 01.02.2024 - 31.01.2025

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AT CHF	0.800	1.200	0.600	0.200	4.000
DT CHF	0.390	0.700	0.290	0.100	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

Benchmark

ICE BofAML Global Corporate Bond Index 1 – 5 Jahre

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.

Thesaurierung des Nettoertrags 2024 / 2025

Ex-Datum: 06.05.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 09.05.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AT CHF	Ja	CHF	2.574	0.900	1.674
DT CHF	Ja	CHF	2.962	1.036	1.926
NT CHF	Ja	CHF	3.137	1.097	2.040

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.
- 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: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

7 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1 % des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

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

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

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

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Pension Bond Fund**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD

und des **Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, ein Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate (nachfolgend der/die "Umbrella-Fonds") zu vereinigen und die Fondsverträge der Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen beim Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund.

In Teil III dieser Veröffentlichung werden die zusätzlichen Anpassungen betreffend die Schaffung neuer Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert.

Im Übrigen werden einzelne Anpassungen der Fondsverträge formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisssanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Pension Bond Fund	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Bond Fund Corporate	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisssanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD	Swisssanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF	16. Mai 2024

2 Gründe für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 24 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplante Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist beim übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 24 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisssanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum das übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Pension Bond Fund mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Bond Fund Corporate vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Pension Bond Fund erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile

der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)
DA USD	DA CHF
NT USD	NT CHF

Die Anleger erhalten somit nach dem Umtausch neu Anteile mit Währung CHF.

Am 17. Mai 2024 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate bzw. übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund aufgrund der Schlusskurse vom 16. Mai 2024 durchgeführt. Am 17. Mai 2024 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 16. Mai 2024 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 12. Januar 2024 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie den Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.swissfunddata.ch veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund und des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	14. Mai 2024
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	14. Mai 2024
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	15. bis 21. Mai 2024
Stichtag Vereinigung		16. Mai 2024

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene der an der Vereinigung beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens

Im Hinblick auf die Vereinigung muss der Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 24 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen für die Vereinigung in Einklang zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend);
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend);
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend);
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend); und
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigung und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens erhält die neue Überschrift "Zulässige Anlagen". Überdies lauten die Bestimmungen in § 8 Ziff. 1 Bst. d des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens betreffend zulässige Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen neu wie folgt:

"Anteile an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds), wenn (i) deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 10% begrenzen; (ii) für diese Zielfonds in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds und (iii) diese Zielfonds im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 19 Anteile von Zielfonds erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist."

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 2C Bst. a-c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird umfassend angepasst und lautet neu wie folgt:

"a) Die Fondsleitung investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens des Teilvermögens in:

aa) Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -wertrechte) von in- und ausländischen nicht staatlichen Emittenten (Nicht-Regierungs-Anleihen), welche bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF gegen die Risiken von

Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung (Schweizer Franken (CHF)) abgesichert sind;

- ab) Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen, die gemäss ihren Dokumenten ihr Vermögen gemäss den Richtlinien dieses Teilvermögens oder Teilen davon anlegen;
- ac) Derivate (einschliesslich Warrants) auf die oben erwähnten Anlagen;
- ad) strukturierte Produkte wie namentlich Zertifikate von Emittenten weltweit auf die oben erwähnten Anlagen.

Bei Anlagen in andere kollektive Kapitalanlagen gemäss Bst. ab vorstehend, Derivaten gemäss Bst. ac vorstehend und strukturierten Produkten gemäss Bst. ad vorstehend, stellt die Fondsleitung sicher, dass auf konsolidierter Basis mindestens zwei Drittel des Vermögens des Teilvermögens in Anlagen gemäss Bst. aa vorstehend investiert sind.

- b) Die Fondsleitung kann zudem unter Vorbehalt von Bst. c höchstens ein Drittel des Fondsvermögens investieren in:
 - ba) Forderungswertpapiere und -rechte von in- und ausländischen Emittenten, die den in Ziff. 2 Bst. aa genannten Anforderungen nicht genügen;
 - bb) Wandelobligationen, Wandelnotes und Optionsanleihen in- und ausländischer Emittenten;
 - bc) Geldmarktinstrumente von in- und ausländischen Emittenten;
 - bd) Aktien und andere Beteiligungswertpapiere und -rechte von Unternehmen weltweit;
 - be) Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen, die den in Ziff. 2 Bst. ab genannten Anforderungen nicht genügen;
 - bf) Derivate (einschliesslich Warrants) auf die oben erwähnten Anlagen;
 - bg) strukturierte Produkte wie namentlich Zertifikate von Emittenten weltweit auf die oben erwähnten Anlagen;
 - bh) Bankguthaben bei in- und ausländischen Banken.
- c) Zusätzlich hat die Fondsleitung die nachstehenden Anlagebeschränkungen, die sich auf das Vermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten:
 - andere kollektive Kapitalanlagen insgesamt höchstens 10%
 - Wandelobligationen, Wandelnotes und Optionsanleihen höchstens 25%
 - Contingent Convertible Bonds höchstens 10%
 - Aktien und andere Beteiligungswertpapiere und -rechte sowie Derivate (einschliesslich Warrants) auf solche Anlagen insgesamt höchstens 10%."

Bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik stützt sich der Vermögensverwalter auf Daten von Drittanbietern, wobei gemäss § 8 Ziff. 2C Bst. d des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens nun eine Präzisierung erfolgt, dass je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel Daten von MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research beigezogen werden können. Im Umfang von höchstens 33% des Vermögens des Teilvermögens (nach Abzug der flüssigen Mittel in Form von Bankguthaben) behält sich der Vermögensverwalter bei indirekten Anlagen über kollektive Kapitalanlagen oder über engagementerhöhende Derivate vor, die Nachhaltigkeitspolitik nicht anzuwenden. Eine Ausnahme bilden engagementerhöhende Derivate, denen nebst Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen nun auch Beteiligungspapiere zugrunde liegen (vgl. § 8 Ziff. 2C Bst. d des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

2.2 Flüssige Mittel

In den Vorschriften über flüssige Mittel (vgl. § 9 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens) wird ergänzt, dass nebst Bankguthaben auch Forderungen aus Pensionsgeschäften auf Sicht und auf Zeit mit Laufzeiten bis zu zwölf Monaten als flüssige Mittel gelten.

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Derivate der zu vereinigenden Teilvermögen werden dahingehend angepasst, dass bei der Risikomessung neu der Commitment-Ansatz II zur Anwendung gelangt (bisher Commitment-Ansatz I) (vgl. § 12 Ziff. 2, 3, 4 Bst. c-f und 8 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). In der Folge lauten die geänderten Bestimmungen wie folgt:

- "2. Bei der Risikomessung gelangt der Commitment-Ansatz II zur Anwendung. Das mit Derivaten verbundene Gesamtengagement des Teilvermögens darf somit 100% seines Nettovermögens und das Gesamtengagement insgesamt 200% seines Nettovermögens nicht überschreiten. Unter Berücksichtigung der Möglichkeit der vorübergehenden Kreditaufnahme des Teilvermögens im Umfang von höchstens 10% des Nettovermögens gemäss § 13 Ziff. 2 kann das Gesamtengagement des Teilvermögens insgesamt bis zu 210% seines Nettovermögens betragen. Die Ermittlung des Gesamtengagements erfolgt gemäss Art. 35 KKV-FINMA.
3. Die Fondsleitung kann insbesondere Derivat-Grundformen wie Call- oder Put-Optionen, deren Wert bei Verfall linear von der positiven oder negativen Differenz zwischen dem Verkehrswert des Basiswerts und dem Ausübungspreis abhängt und null wird, wenn die Differenz das andere Vorzeichen hat, Credit Default Swaps (CDS), Swaps, deren Zahlungen linear und pfad-unabhängig vom Wert des Basiswerts oder einem absoluten Betrag abhängen sowie Termingeschäfte (Futures und Forwards), deren Wert linear vom Wert des Basis-werts abhängt, einsetzen. Sie kann zusätzlich auch Kombinationen von Derivat-Grundformen sowie Derivate, deren ökonomische Wirkungsweise weder durch eine Derivat-Grundform noch durch eine Kombination von Derivat-Grundformen beschrieben werden kann (exotische Derivate), einsetzen.
- 4.
- c) Bei einem überwiegenden Einsatz von Zinsderivaten kann der Betrag, der an das Gesamtengagement aus Derivaten anzurechnen ist, mittels international anerkannten Duration-Netting-Regelungen ermittelt werden, sofern die Regelungen zu einer korrekten Ermittlung des Risikoprofils des Teilvermögens führen, die wesentlichen Risiken berücksichtigt werden, die Anwendung dieser Regelungen nicht zu einer ungerechtfertigten Hebelwirkung führt, keine Zinsarbitrage-Strategien verfolgt werden und die Hebelwirkung des Teilvermögens weder durch Anwendung dieser Regelung noch durch Investitionen in kurzfristige Positionen gesteigert wird.
- d) Derivate, die zur reinen Absicherung von Fremdwährungsrisiken eingesetzt werden und nicht zu einer Hebelwirkung führen oder zusätzliche Marktrisiken beinhalten, können ohne die Anforderungen gemäss Bst. b bei der Berechnung des Gesamtengagements aus Derivaten verrechnet werden.
- e) Zahlungsverpflichtungen aus Derivaten müssen dauernd mit geldnahen Mitteln, Forderungswertpapieren und -rechten oder Aktien, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, nach Massgabe der Kollektivanlagengesetzgebung gedeckt sein.
- f) Geht die Fondsleitung mit einem Derivat eine Verpflichtung zur physischen Lieferung eines Basiswerts ein, muss das Derivat mit den entsprechenden Basiswerten gedeckt sein oder mit anderen Anlagen, wenn die Anlagen und die Basiswerte hoch liquide sind und bei einer verlangten Lieferung jederzeit erworben oder verkauft werden können. Die Fondsleitung muss jederzeit uneingeschränkt über diese Basiswerte oder Anlagen verfügen können.
8. Der Prospekt enthält weitere Angaben:
- zur Bedeutung von Derivaten im Rahmen der Anlagestrategie
 - zu den Auswirkungen der Derivatverwendung auf das Risikoprofil der Teilvermögen
 - zu den Gegenparteirisiken von Derivaten
 - zu der aus der Verwendung von Derivaten resultierenden erhöhten Volatilität und dem erhöhten Gesamtengagement (Hebelwirkung)
 - zu den Kreditderivaten
 - zur Sicherheitenstrategie"

2.4 Risikoverteilung und weitere Anlagerestriktionen

Hinsichtlich der Risikoverteilungsvorschriften werden die Indexfonds nicht mehr explizit als eine Ausnahme im Zusammenhang mit dem Einbezug von Anlagen aufgeführt (vgl. Anpassung in § 15 Ziff. 1 Bst. a des Fondsvertrages). Des Weiteren findet in derselben Bestimmung eine Präzisierung statt, wonach die Risikoverteilungsvorschriften für jedes Teilvermögen einzeln gelten (vgl. § 15 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

In Ziff. 3 von § 15 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens ist neu vorgesehen, dass die Fondsleitung einschliesslich der Derivate und strukturierten Produkte höchstens 10% (bisher ebenfalls 10%) des Vermögens eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten anlegen darf. Der Gesamtwert der Effekten und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei welchen mehr als 5% des Vermögens eines Teilvermögens angelegt sind, darf 40% des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens nicht übersteigen. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen von § 15 Ziff. 4 und 5.

Die Fondsleitung hat gemäss der neuen Ziff. 4 in § 15 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens die Limite von 20% (bisher 15%) bei Anlagen von Vermögen eines Teilvermögens in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank zu berücksichtigen.

Die bisherige Bestimmung in Ziffer 5 ist neu in Ziffer 8 aufgeführt.

In der geänderten Ziffer 5 des angepassten Fondsvertrages wird ausgeführt, dass die Fondsleitung höchstens 5% (bisher ebenfalls 5%) des Vermögens eines Teilvermögens in OTC-Geschäften bei derselben Gegenpartei anlegen darf. Ist die Gegenpartei eine Bank, die ihren Sitz in der Schweiz oder in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union hat oder in einem anderen Staat, in welchem sie einer Aufsicht untersteht, die derjenigen in der Schweiz gleichwertig ist, so erhöht sich diese Limite auf 10% des entsprechenden Teilvermögens. Der zweite Absatz der bisherigen Bestimmung in Ziff. 8.3 betreffend die Absicherung von Forderungen aus OTC-Geschäften findet sich neu ebenfalls in Ziffer 5 (vgl. § 15 Ziff. 5 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss § 15 Ziff. 3 bis 5 desselben Emittenten bzw. Schuldners dürfen insgesamt 20% (bisher 15%) des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen (vgl. § 15 Ziff. 6 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Zudem wird neu festgehalten, dass Anlagen gemäss § 15 Ziff. 3 derselben Unternehmensgruppe insgesamt 20% (bisher 15%) des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen dürfen (vgl. § 15 Ziff. 7 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens wird noch eine weitere Ergänzung vorgenommen, wonach die Beschränkungen gemäss § 15 Ziff. 9 und 10 nicht anwendbar auf Effekten und Geldmarktinstrumente sind, die von einem Staat oder einer öffentlich-rechtlichen Körperschaft aus der OECD oder von internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen die Schweiz oder ein Mitgliedstaat der Europäischen Union begeben oder garantiert werden (vgl. § 15 Ziff. 11 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten

In § 22 Ziff. 1 wird die Bestimmung im Zusammenhang mit der Unterscheidung der Anteilklassen der Teilvermögen hinsichtlich Ausschüttung oder Thesaurierung ersatzlos gestrichen.

4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen

In § 18 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird neu ausgeführt, dass dem Anleger eine Ausgabekommission zugunsten der Fondsleitung, der Depotbank und/oder von Vertreibern, bei Zeichnungen in bar zusammen höchstens 5% (bisher 2%) des gemäss § 16 Ziff. 7 des Fondsvertrages modifizierten Nettoinventarwertes der Anteile bzw. bei Einzahlungen in Anlagen zusammen höchstens 5% (bisher 2%) des gemäss § 16 Ziff. 6 des Fondsvertrages berechneten Bewertungs-Nettoinventarwertes belastet werden darf. Der zurzeit massgebliche Höchstsatz ist aus dem Prospekt ersichtlich. Überdies wird nach Angleichung des Fondsvertrages die Bestimmung, wonach dem Anleger bei der Rücknahme von Anteilen keine Rücknahmekommission belastet wird, gestrichen (vgl. § 18 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Des Weiteren entfällt die bisherige Bestimmung in Ziff. 4 von § 18 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens, nach der für die Auszahlung des Liquidationsbetrags im Falle der Auflösung des Umbrella-Fonds oder eines Teilvermögens dem Anleger keine Kommission belastet wird.

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens wird eine Präzisierung vorgenommen, in welcher darauf hingewiesen wird, dass die Fondsleitung zulasten der Teilvermögen eine jährliche maximale Pauschalkommission bezogen auf das Nettofondsvermögens des jeweiligen Teilvermögens in Rechnung stellt, die pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettoinventarwertes dem Fondsvermögen belastet und jeweils am Monatsende ausbezahlt wird. Die jährliche maximale Pauschalkommission pro Anteilsklasse beträgt neu wie folgt (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens):

Anteilsklassen AT CHF, AT EUR, AT GBP, AT USD, AA CHF, AA EUR, AA GBP, AA USD: 1.20%

Anteilsklassen BT CHF, BT EUR, BT GBP, BT USD, BA CHF, BA EUR, BA GBP, BA USD: 0.90%

Anteilsklassen CT CHF, CT EUR, CT GBP, CT USD, CA CHF, CA EUR, CA GBP, CA USD: 0.75%

Anteilsklassen DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD: 0.70%

Anteilsklassen GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD: 0.60%

Anteilsklassen MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, ST CHF, ST EUR, ST GBP, ST USD, SA CHF, SA EUR, SA GBP, SA USD: 0.00%

Bei den Anteilsklassen MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, ST CHF, ST EUR, ST GBP, ST USD, SA CHF, SA EUR, SA GBP und SA USD der Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration Hedged CHF wird keine pauschale Verwaltungskommission zulasten des Vermögens des Teilvermögens erhoben. Die Entschädigung der Fondsleitung für die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank, erfolgt im Rahmen der in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages genannten vertraglichen Vereinbarungen bzw. Regelungen.

5 Rücknahmebedingungen

In Übereinstimmung mit dem Fondsvertrag des übernehmenden Teilvermögens werden die Zeichnungs- und Rücknahmeanträge für Anteile an jedem Bankwerktag (Auftragstag) bis zu einem bestimmten im Anhang genannten Zeitpunkt von der Depotbank entgegengenommen (vgl. § 17 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gemäss § 16 berechneten Nettoinventarwert je Anteil. Die Präzisierung, wonach der Bewertungstag gestützt auf die Schlusskurse des Vortages basiert, entfällt (vgl. § 17 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Die Bestimmung in § 17 Ziff. 7 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens, der zufolge die Fondsleitung nach Kündigung des Fondsvertrages durch den Anleger auch ohne entsprechenden Antrag des Anlegers beschliessen kann, dem Anleger ganz oder teilweise Anlagen statt einer Barauszahlung zukommen zu lassen, sofern die dadurch entstehenden Kosten und Umtriebe die Interessen der im Teilvermögen verbleibenden Anleger beeinträchtigen würden, wird ersatzlos gestrichen.

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die zu vereinigenden Teilvermögen bestehen auf unbestimmte Zeit. Beim übertragenden Teilvermögen kann die Fondsleitung oder die Depotbank die Auflösung des Teilvermögens durch Kündigung des Fondsvertrages fristlos herbeiführen (vgl. § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Beim übernehmenden Teilvermögen besteht hingegen eine einmonatige Kündigungsfrist (vgl. § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens). Entsprechend wird der Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens dahingehend angepasst, dass in § 25 Ziff. 2 des Fondsvertrages eine Kündigungsfrist von einem Monat eingeführt wird.

Teil III – Schaffung neuer Anteilsklassen beim übernehmenden Umbrella-Fonds

Im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate sind beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate Anpassungen betreffend die Schaffung neuer Anteilsklassen vorgesehen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen.

Neu hinzukommende Anteilsklassen

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate sollen die Anteilsklassen AA EUR, BA EUR, CT EUR, DA EUR und GT EUR neu aufgenommen werden (vgl. § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens). Bis anhin waren Anteilsklassen mit der Anteilsklassenwährung EUR nicht vorgesehen.

Die maximale pauschale Verwaltungskommission (PVK) der neu geschaffenen Anteilsklassen beträgt wie folgt (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens):

Anteilsklasse AA EUR: 1.20%
Anteilsklasse BA EUR: 0.90%
Anteilsklasse CT EUR: 0.75%
Anteilsklasse DA EUR: 0.70%
Anteilsklasse GT EUR: 0.60%

Im Einklang mit dem bestehenden Klassenkonzept gilt für die neuen Anteilsklassen betreffend **Anlegerkreis** folgendes:

Anteile der **Anteilsklassen "A"** werden allen Anlegern angeboten und können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

Anteile der **Anteilsklassen "B"** werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vertrag mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

Anteile der **Anteilsklassen "C"** werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Anlageberatungsvertrag mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

Anteile der **Anteilsklassen "D"** stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) sowie Anlegern offen, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklasse stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklasse ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Die Anteile können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

Anteile der **Anteilsklassen "G"** stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) offen, sofern diese einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Investitionsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text

nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklasse stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklasse ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Weitere Voraussetzung ist, dass der Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG eine Kooperationsvereinbarung mit der Swisssanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisssanto Gruppe abgeschlossen hat.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Teil II Ziff. 2 und 5 sowie Teil III der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen der Fondsverträge Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen der Teilvermögen in bar verlangen können bzw. den Antrag auf Sachauslage stellen können.

Die Einführung neuer Anteilsklassen stellt allerdings keine Änderung des Fondsvertrages im Sinne von Art. 27 KAG dar. Gegen die damit verbundenen, in Teil III dieser Publikation erläuterten, Änderungen in § 6 Ziff. 4 und § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds besteht somit kein Einspruchrecht.

Der Fondsvertrag mit Anhang des Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Pension Bond Fund, der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisssanto (CH) Bond Fund Corporate, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 8. März 2024

Die Fondsleitung:

Swisssanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate

ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Effektenfonds"
(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

(nachfolgend "das Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, wie folgt zu ändern:

**Änderung des Verfahrens zur Messung der mit Derivaten verbundenen Risiken beim Teilvermögen
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF**

Beim Teilvermögen gelangt bei der Risikomessung im Zusammenhang mit dem Einsatz von Derivaten bis anhin der Commitment-Ansatz II zur Anwendung. Neu wird auf den Commitment-Ansatz I umgestellt. Der Fondsvertrag wurde entsprechend angepasst (vgl. § 12 des Fondsvertrages).

* * *

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in dieser Mitteilung umschriebene Änderung des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnte Änderung des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 17. Mai 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Pension Bond Fund**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen")

und des **Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

hinsichtlich

Vereinigung vom 16. Mai 2024

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigungen;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 16. Mai 2024 vereinigt. Die Anlegerinnen und Anleger wurden mittels Publikation vom 8. März 2024 in den Publikationsorganen der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über dessen Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 16. Mai 2024 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögen auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnis

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anlegerinnen und Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 16. Mai 2024:

Übertragendes Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD	DA USD	CH0021284283	USD 110.59
	NT USD	CH0192251954	USD 111.55

Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF	DA CHF	CH0025616829	CHF 83.02
	NT CHF	CH0192241492	CHF 100.81

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergeben sich folgende Umtauschverhältnisse aus Sicht des übertragenden Teilvermögen (1 Anteil des übertragenden Teilvermögen ↔ Anzahl Anteile des übernehmenden Teilvermögen):

Übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis ¹
Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD	DA USD	1 zu 1.2047549683
	NT USD	1 zu 1.0007893586

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 27. Mai 2024 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Pension Bond Fund Responsible Plus USD (übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Pension Bond Fund») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate») per 16. Mai 2024 geprüft.

Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH), wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss dem Fondsvertrag ordnungsgemäss durchgeführt.

Ernst & Young AG
Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber"

Der Fondsvertrag mit Anhang des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Bond Fund und der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. Juni 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Effektenfonds"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Anpassungen in der Nachhaltigkeitspolitik

Nebst formellen Änderungen wird im Fondsvertrag ein Hinweis auf das auf Institutsebene nach Massgabe interner Konzepte zur Anwendung gelangende Stewardship (Voting & Engagement) aufgenommen, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. da und Bst. db des geänderten Fondsvertrages.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. September 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich