

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE CHF

Jahresbericht per 31.01.2023

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	277966	CHF
BA CHF	20594630	CHF
CT CHF	37873018	CHF
GT CHF	123508057	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Zürich, 26. Mai 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate CHF, Zürich

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate CHF, bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Januar 2023, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigefügte Jahresrechnung 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 Jahresrechnung“ 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.



Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnung 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 einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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 Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung 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 der Gesellschaft 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

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Januar 2023, der Erfolgsrechnung 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	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Collateral ausgeliehene Effekten	12
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	12
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	12
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
8	Pauschale Verwaltungskommission	13
9	Benchmark	13
10	TER	14
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	14
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	14
13	Fussnoten	14
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen	15 17

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021	31.01.2020
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		74'930'967.71	80'076'659.18	96'757'827.80	114'325'915.12
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		61'748'111.50	76'817'498.74	92'643'836.05	110'162'490.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		694'234.569	805'042.075	952'393.705	1'124'842.049
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		88.9442	95.4205	97.2700	97.9400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		88.6329	95.3155	97.1700	97.8400
Ausschüttung je Anteil		-	-	0.20	-
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'986'590.20	2'145'230.17	2'112'219.23	2'184'942.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		21'284.835	21'379.092	20'697.543	21'224.863
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		93.3336	100.3424	102.0500	102.9400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		93.0069	100.2321	101.9400	102.8400
Ausschüttung je Anteil		0.40	0.60	0.40	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		784'364.38	1'113'930.27	2'001'772.52	1'978'482.65
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'269.981	10'978.808	19'449.969	19'147.807
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		94.8448	101.4619	102.9200	103.3300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		94.5128	101.3503	102.8100	103.2200
Thesaurierung je Anteil		0.47	0.53	0.55	0.55
Total Expense Ratio (TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'411'901.63			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		104'545.496			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.5921			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.2435			
Thesaurierung je Anteil		0.10			
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %			

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	-7.01 %	-9.68 %	-0.51 %	0.29 %
Klasse BA CHF	-6.62 %	-9.31 %	-0.09 %	0.72 %
Klasse CT CHF	-6.56 %	-9.25 %	-0.03 %	0.78 %
Klasse GT CHF (Lancierung 07.12.2022)	-0.01 %	-1.73 %	-	-

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)	31.01.2023	31.01.2022
Bankguthaben auf Sicht	2'566'663.11	2'870'952.99
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	71'685'020.00	76'676'782.50
Derivative Finanzinstrumente	174'923.13	39'462.39
Sonstige Vermögenswerte	566'539.74	560'579.28
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	74'993'145.98	80'147'777.16
Andere Verbindlichkeiten	-62'178.27	-71'117.98
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	74'930'967.71	80'076'659.18

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		805'042.075	952'393.705
Ausgegebene Anteile		5'767.251	9'016.619
Zurückgenommene Anteile		-116'574.757	-156'368.249
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		694'234.569	805'042.075

Klasse BA CHF	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		21'379.092	20'697.543
Ausgegebene Anteile		-	681.549
Zurückgenommene Anteile		-94.257	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		21'284.835	21'379.092

Klasse CT CHF	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'978.808	19'449.969
Ausgegebene Anteile		1'040.000	920.673
Zurückgenommene Anteile		-3'748.827	-9'391.834
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'269.981	10'978.808

Klasse GT CHF	von bis	Lancierung 07.12.2022 31.01.2023
Ausgegebene Anteile		106'094.365
Zurückgenommene Anteile		-1'548.869
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		104'545.496

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		80'076'659.18	96'757'827.80
Ausbezahlte Ausschüttung		-12'827.46	-188'902.52
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'983.54	-3'679.91
Saldo aus dem Anteilverkehr		113'005.60	-15'081'576.16
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-5'243'886.07	-1'407'010.03
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		74'930'967.71	80'076'659.18

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		759.74	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-5'069.32	-13'073.96
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		744'236.71	977'710.44
Erträge aus Wertpapierleihe		15'678.75	11'079.50
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'849.14	1'022.97
Total Ertrag		759'455.02	976'738.95
Aufwand			
Passivzinsen		-26.50	-141.30
Reglementarische Vergütungen		-724'000.35	-921'079.21
Sonstige Aufwendungen		-10.60	-52.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-10'422.95	-14'670.97
Total Aufwand		-734'460.40	-935'944.38
Nettoertrag / Verlust		24'994.62	40'794.57
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'814'981.17	383'704.60
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		75'912.86	18'506.29
Realisierter Erfolg		-1'714'073.69	443'005.46
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'529'812.38	-1'850'015.49
Gesamterfolg		-5'243'886.07	-1'407'010.03

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2023	31.01.2022
Nettoertrag	999.79	24'731.32
Vortrag des Vorjahres	66'617.55	41'886.23
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	67'617.34	66'617.55
Vortrag auf neue Rechnung	67'617.34	66'617.55
Total	67'617.34	66'617.55
<hr/>		
Klasse BA CHF	31.01.2023	31.01.2022
Nettoertrag	8'700.57	10'159.38
Vortrag des Vorjahres	156.45	2'824.53
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'857.02	12'983.91
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	8'513.93	12'827.46
Vortrag auf neue Rechnung	343.09	156.45
Total	8'857.02	12'983.91
<hr/>		
Klasse CT CHF	31.01.2023	31.01.2022
Nettoertrag	3'902.30	5'903.87
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'902.30	5'903.87
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'365.81	2'066.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'536.49	3'837.52
Total	3'902.30	5'903.87
<hr/>		
Klasse GT CHF	31.01.2023	
Nettoertrag	11'391.96	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	11'391.96	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'987.19	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'404.77	
Total	11'391.96	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							71'685'020.00	95.59	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							71'685'020.00	95.59	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.35%	913'500.00	1.22	a)
AE							913'500.00	1.22	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	1.36	a)
AT							1'023'000.00	1.36	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH040906362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.05%	970'500.00	1.29	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.60%	906'000.00	1.21	a)
AU							1'876'500.00	2.50	
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.90%	889'000.00	1.19	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	1.30	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	1.33	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.85%	998'500.00	1.33	a)
CA							3'860'500.00	5.15	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'000	0	0	1'000 CHF	101.60%	1'016'000.00	1.35	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0122526608	2.6250 % ENAG 2 5/8 01/31/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'000	0	0	1'000 CHF	100.65%	1'006'500.00	1.34	a)
CH0212184037	4.5325 % ALPHSW FLOAT PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	95.00%	950'000.00	1.27	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLIL 2 3/8 12/10/26	1'250	0	0	1'250 CHF	100.35%	1'254'375.00	1.67	a)
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	1'000	0	0	1'000 CHF	100.70%	1'007'000.00	1.34	a)
CH0275776430	1.1250 % ISHZ 1 1/8 04/17/23	1'000	0	0	1'000 CHF	99.68%	996'800.00	1.33	a)
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23	0	1'000	0	1'000 CHF	99.22%	992'200.00	1.32	a)
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	0	1'000	0	1'000 CHF	98.83%	988'300.00	1.32	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533224	0.7500 % IRENSW 0 3/4 10/03/22	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	725	0	500	225 CHF	94.60%	212'850.00	0.28	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	1'500	0	500	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	1.30	a)
CH0398633724	3.5000 % HOLNSW 3 1/2 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	99.50%	995'000.00	1.33	a)
CH0398677739	0.5500 % AMALEA 0.55 02/10/23	0	2'000	0	2'000 CHF	99.97%	1'999'400.00	2.67	a)
CH0406990801	2.6250 % SLHNVX 2 5/8 09/25/48	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	1'000	0	0	1'000 CHF	89.45%	894'500.00	1.19	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'500	0	0	1'500 CHF	98.90%	1'483'500.00	1.98	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	900	0	0	900 CHF	95.85%	862'650.00	1.15	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'000	0	0	1'000 CHF	83.40%	834'000.00	1.11	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'000	0	0	1'000 CHF	70.25%	702'500.00	0.94	a)
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	1'000	0	0	1'000 CHF	99.65%	996'500.00	1.33	a)
CH0419042566	2.6250 % VONTOB 2 5/8 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	97.70%	977'000.00	1.30	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	1'000	0	0	1'000 CHF	98.95%	989'500.00	1.32	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.25%	942'500.00	1.26	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'250	0	0	1'250 CHF	95.50%	1'193'750.00	1.59	a)
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	500	0	0	500 CHF	84.80%	424'000.00	0.57	a)
CH0494734384	3.0000 % CS 3 PERP	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0508785778	0.0000 % SWMOB 2019-1 A	2'060	0	2'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	94.25%	942'500.00	1.26	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'000	0	0	1'000 CHF	82.70%	827'000.00	1.10	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893172	1.5000 % BCHNSW 1 1/2 09/30/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.30%	993'000.00	1.32	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763522	0.7500 % COOPSW 0 3/4 05/05/23	0	1'000	0	1'000 CHF	99.76%	997'600.00	1.33	a)
CH0539032943	1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23	1'000	0	500	500 CHF	99.74%	498'700.00	0.66	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	1.30	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	320	0	0	320 CHF	95.00%	304'000.00	0.41	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'000	0	0	1'000 CHF	89.40%	894'000.00	1.19	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'000	0	0	1'000 CHF	90.60%	906'000.00	1.21	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	700	0	700 CHF	86.55%	605'850.00	0.81	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	850	0	0	850 CHF	83.75%	711'875.00	0.95	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	570	0	0	570 CHF	95.05%	541'785.00	0.72	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	0	1'000	0	1'000 CHF	89.75%	897'500.00	1.20	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000	0	0	1'000 CHF	83.85%	838'500.00	1.12	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	0	1'000	0	1'000 CHF	83.55%	835'540.00	1.11	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	0	900	0	900 CHF	98.00%	882'000.00	1.18	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	650	0	650 CHF	103.70%	674'050.00	0.90	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	875	0	875 CHF	101.10%	884'625.00	1.18	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.55%	1'005'500.00	1.34	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	0	1'000	0	1'000 CHF	99.50%	995'000.00	1.33	a)
CH							38'900'350.00	51.87	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.80%	918'000.00	1.22	a)
CL							918'000.00	1.22	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0399198396	0.6250 % DB 0 5/8 02/08/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.65%	986'500.00	1.32	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	84.15%	841'500.00	1.12	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	88.65%	709'200.00	0.95	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	87.35%	873'500.00	1.16	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	1.36	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	600	0	600 CHF	99.35%	596'100.00	0.79	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.94%	999'370.00	1.33	a)
DE							6'022'670.00	8.03	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000	0	0	1'000 CHF	94.20%	942'000.00	1.26	a)
ES							942'000.00	1.26	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	1.32	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.80%	898'000.00	1.20	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.00%	880'000.00	1.17	a)
FR							2'768'500.00	3.69	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	0	600	0	600 CHF	84.10%	504'600.00	0.67	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	88.20%	882'000.00	1.18	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	0	650 CHF	96.50%	627'250.00	0.84	a)
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	96.70%	967'000.00	1.29	a)
GB							2'980'850.00	3.97	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	1.29	a)
CH1100259816	3.1250 % RURAIL 3 1/8 PERP	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
IE							969'000.00	1.29	
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
JE							0.00	0.00	
CH0391648026	0.3750 % ADCBUH 0 3/8 01/23/23 GMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH0448036266	3.2500 % KTKZK 3 1/4 12/05/23	1'230	0	1'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KZ							0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	500	0	0	500 CHF	91.05%	455'250.00	0.61	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LU							455'250.00	0.61	
CH0467182397	1.5500 % BANORT 1.55 10/11/22	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
MX							0.00	0.00	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	0	1'000	100	900 CHF	92.70%	834'300.00	1.11	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'800	0	800	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	1.28	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	1'250	0	1'250 CHF	86.25%	1'078'125.00	1.44	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	1.27	a)
NL							3'829'425.00	5.11	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	87.35%	873'500.00	1.16	a)
NZ							873'500.00	1.16	
CH0418609613	0.5650 % MBKPW 0.565 06/07/22 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
PL							0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.75%	947'500.00	1.26	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	1'000	0	1'000 CHF	90.70%	907'000.00	1.21	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.70%	897'000.00	1.20	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	87.00%	870'000.00	1.16	a)
US							3'621'500.00	4.83	
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	750	0	0	750 CHF	97.89%	734'175.00	0.98	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.63%	996'300.00	1.33	a)
XS							1'730'475.00	2.31	

Derivative Finanzinstrumente

							174'923.13	0.23	
Kreditderivate							126'678.12	0.17	

12/26	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/26	-1'200	1'200	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/26	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.37 12/26	-1'200	1'200	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/26	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/26	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/26	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/26	6'100	0	6'100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/26	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.37 12/26	6'700	0	6'700	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 06/27	0	5'600	5'600	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.38 06/27	0	6'100	6'100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.38 06/27	0	1'100	1'100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/27	0	5'100	0	5'100 EUR	1.03	52'364.37	0.07	a)
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	0	0	1'000	-1'000 EUR	3.90	-38'939.22	-0.05	a)
12/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.39 12/27	0	0	900	-900 USD	3.06	-25'265.67	-0.03	a)
12/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.39 12/27	0	5'000	0	5'000 USD	1.32	60'640.22	0.08	a)
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	0	2'000	0	2'000 EUR	3.90	77'878.42	0.10	a)

Swaps

							48'245.01	0.06	
01/25	IRS FIX LEG -0.3125% P.A. CHF	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/25	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	-5'000	5'000	0	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
01/25	IRS FIX LEG -0.285% P.A. CHF	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/25	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	-5'000	5'000	0	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/29	IRS FIX LEG 0.38% P.A. CHF	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
03/29	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/32	IRS FIX LEG 1.8775% P.A. CHF	0	3'000	0	3'000 CHF	101.61%	3'048'245.01	4.06	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
12/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	0	3'000	-3'000 CHF	100.00	-3'000'000.00	-4.00	b)
01/37	IRS FIX LEG 0.3575% P.A. CHF	-2'000	2'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
01/37	IRS FLOATING LEG - CHF-SARON-OIS-COMPOUND	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'566'663.11	3.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	71'685'020.00	95.59
Derivative Finanzinstrumente	174'923.13	0.23
Sonstige Vermögenswerte	566'539.74	0.76
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	74'993'145.98	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-62'178.27	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	74'930'967.71	

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);	71'811'698.12	95.76
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	48'245.01	0.06
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

	17'895'220.00	23.86
--	----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

					Kurswert CHF	in % 7)	
CH0212184037	4.5325 % ALPHSW FLOAT PERP	1'000	500	CHF	95.00%	475'000.00	0.63
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	1'000	1'000	CHF	99.05%	990'500.00	1.32
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	0	500	CHF	98.83%	494'150.00	0.66
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	725	225	CHF	94.60%	212'850.00	0.28
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000	1'000	CHF	94.20%	942'000.00	1.26
CH0398633724	3.5000 % HOLNSW 3 1/2 PERP	1'000	1'000	CHF	99.50%	995'000.00	1.33
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	900	900	CHF	95.85%	862'650.00	1.15
CH0419042566	2.6250 % VONTOB 2 5/8 PERP	1'000	1'000	CHF	97.70%	977'000.00	1.30
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	750	300	CHF	97.89%	293'670.00	0.39
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'250	1'250	CHF	95.50%	1'193'750.00	1.59
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'000	500	CHF	82.70%	413'500.00	0.55
CH0536893172	1.5000 % BCHNSW 1 1/2 09/30/24	1'000	1'000	CHF	99.30%	993'000.00	1.32
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	320	320	CHF	95.00%	304'000.00	0.41
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'000	900	CHF	89.40%	804'600.00	1.07
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	1'000	500	CHF	91.35%	456'750.00	0.61
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000	1'000	CHF	89.70%	897'000.00	1.20
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	700	CHF	86.55%	605'850.00	0.81
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	1'000	500	CHF	87.00%	435'000.00	0.58
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	800	800	CHF	88.65%	709'200.00	0.95
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	0	600	CHF	84.10%	504'600.00	0.67
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	1'000	1'000	CHF	90.60%	906'000.00	1.21
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'000	500	CHF	88.00%	440'000.00	0.59
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'000	200	CHF	87.35%	174'700.00	0.23
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000	1'000	CHF	83.85%	838'500.00	1.12
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	650	CHF	103.70%	674'050.00	0.90
CH1204175124	1.9150 % NWISE 1.915 09/08/28 EMTN	0	500	CHF	96.70%	483'500.00	0.64
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	800	CHF	102.30%	818'400.00	1.09

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.99780618
USD	1 = CHF	0.91875000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	7'855'600.30	38.381
Bond	CHF	11'931'244.54	58.293
Equity	CHF	680'804.58	3.326
Total	CHF	20'467'649.42	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	16'551'100.07	22.088
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	11'858'522.78	15.826
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2022 - 31.01.2023

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	17'895'220.00
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2022 - 31.01.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000
BA CHF	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000
CT CHF	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000

Periode: 08.12.2022 - 31.01.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000

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

9 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

10 TER

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

11 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 09.05.2023 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 12.05.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	-	-	-
BA CHF	Nein	CHF	0.40000	0.14000	0.26000

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 09.05.2023 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 12.05.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.47186	0.16515	0.30671
GT CHF	Nein	CHF	0.10896	0.03813	0.07083

13 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 23) Anpassung der Nachkommastellen von 2 auf 4 per 16.12.2021.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimit (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimit zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens 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 Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, 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 Anlagefonds gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des Anlagefonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 einer Erhöhung des Nettovermögens des Anlagefonds führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Anlagefonds 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.5.2.2) 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 Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anleger
des
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate CHF
ein vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts
der Art "Effektenfonds "
(nachfolgend „Anlagefonds“)

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

Im Fondsvertrag erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

1. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 9 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben."

2. Keine Regelung der Umwandlung mehr

Bisher wurde in § 24 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 24 des Fondsvertrages und in § 24 Ziff. 9 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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 1 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich