

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE GLOBAL CORPORATE

Jahresbericht per 31.01.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Bond Fund Corporate
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

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

Rechnungswährung: EUR

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, 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 beigefügten 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 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

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, 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	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	18
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	18
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
7	Pauschale Verwaltungskommission	20
8	Benchmark	20
9	TER	21
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
12	Fussnoten	21
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	22
14	Pflichtpublikationen	24

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		67'847'497.11	47'823'862.75	43'158'488.97	50'912'656.82
Klasse AAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		28'774'000.47	32'163'915.04	29'936'518.16	36'995'925.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		267'020.066	308'480.512	256'629.831	305'854.100
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.7597	104.2656	116.6525	120.9600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		107.6304	104.1405	116.7692	121.2500
Ausschüttung je Anteil		2.05	0.90	0.60	0.60
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		314'155.75	320'457.56	433'967.58	379'661.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'589.191	4'349.201	3'660.280
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.3197	89.2841	99.7810	103.7200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.2089	89.1769	99.8808	103.9700
Ausschüttung je Anteil		2.15	1.10	0.80	1.20
Total Expense Ratio (TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CTH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'829'470.74	6'646'053.63	559'852.78	572'859.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		60'784.456	72'292.551	5'478.942	5'438.942
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.9040	91.9328	102.1826	105.3300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.7889	91.8224	102.2848	105.5800
Thesaurierung je Anteil		2.26	1.08	1.02	1.15
Total Expense Ratio (TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DAH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		678'677.71	974'209.67	2'776'936.68	2'485'093.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	11'167.953	28'424.642	24'525.134
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.1859	87.2326	97.6947	101.3300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		90.0777	87.1279	97.7924	101.5700
Ausschüttung je Anteil		2.25	1.25	1.20	1.20
Total Expense Ratio (TER)		0.44 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %
Klasse GTH1 EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'541'258.12	7'719'226.85	9'451'213.77	10'479'117.44
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		40'640.000	72'141.628	79'600.429	85'778.377
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.7436	107.0010	118.7332	122.1700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.6095	106.8726	118.8519	122.4600
Thesaurierung je Anteil		2.85	1.54	1.52	1.65
Total Expense Ratio (TER)		0.35 %	0.30 %	0.30 %	0.30 %

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		27'709'934.32			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		258'886.000			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.7395			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.6198			
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		0.13			
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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AAH1 EUR	4.25 %	6.60 %	-13.10 %	-1.88 %
Klasse BAH1 EUR	4.69 %	7.05 %	-12.74 %	-1.47 %
Klasse CTH1 EUR	4.75 %	7.11 %	-12.68 %	-1.41 %
Klasse DAH1 EUR	4.89 %	7.24 %	-12.40 %	-1.23 %
Klasse GTH1 EUR	4.96 %	7.32 %	-12.32 %	-1.15 %
Klasse NT CHF (Lancierung 19.01.2024)	-0.14 %	-	-	-

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)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	2'007'320.71	556'430.63
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	65'043'288.02	46'829'086.23
Sonstige Vermögenswerte	829'535.55	473'912.29
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	67'880'144.28	47'859'429.15
Andere Verbindlichkeiten	-32'647.17	-35'566.40
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	67'847'497.11	47'823'862.75

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse AAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		308'480.512	256'629.831
Ausgegebene Anteile		1'574.590	852.724
Zurückgenommene Anteile		-43'035.036	-44'579.936
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		267'020.066	308'480.512
Klasse BAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'589.191	4'349.201
Ausgegebene Anteile		-	351.990
Zurückgenommene Anteile		-186.280	-1'112.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'402.911	3'589.191
Klasse CTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		72'292.551	5'478.942
Ausgegebene Anteile		886.095	4'342.267
Zurückgenommene Anteile		-12'394.190	-7'612.184
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		60'784.456	72'292.551
Klasse DAH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'167.953	28'424.642
Ausgegebene Anteile		-	209.000
Zurückgenommene Anteile		-3'642.632	-17'465.689
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'525.321	11'167.953
Klasse GTH1 EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		72'141.628	79'600.429
Ausgegebene Anteile		1'632.000	3'067.000
Zurückgenommene Anteile		-33'133.628	-10'525.801
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		40'640.000	72'141.628
Klasse NT CHF			
		<i>Lancierung</i> 19.01.2024	
Ausgegebene Anteile		259'229.000	
Zurückgenommene Anteile		-343.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		258'886.000	

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		47'823'862.75	43'158'488.97
Ausbezahlte Ausschüttung		-283'534.99	-178'092.51
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-65'443.89	-43'399.42
Saldo aus dem Anteilverkehr		18'403'018.49	8'921'794.57
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'969'594.75	-4'034'928.86
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		67'847'497.11	47'823'862.75

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		18'651.62	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-20.99	-2'261.35
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'289'392.88	778'122.61
Erträge aus Wertpapierleihe		6'880.47	10'211.22
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		0.00	72'840.89
Sonstige Erträge		0.00	-0.08
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		7'802.70	4'713.37
Total Ertrag		1'322'706.68	863'626.66
Aufwand			
Passivzinsen		-0.05	0.00
Reglementarische Vergütungen		-377'591.33	-381'125.84
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-83'866.05	-49'709.20
Total Aufwand		-461'457.43	-430'835.04
Nettoertrag / Verlust		861'249.25	432'791.62
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'060'218.11	-328'132.89
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		44'311.16	11'632.31
Realisierter Erfolg		-4'154'657.70	116'291.04
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		6'124'252.45	-4'151'219.90
Gesamterfolg		1'969'594.75	-4'034'928.86

Verwendung des Erfolges

Klasse AAH1 EUR	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	548'328.72	227'574.33
Vortrag des Vorjahres	970.89	48'670.01
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	549'299.61	278'603.35
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	547'391.14	277'632.46
Vortrag auf neue Rechnung	1'908.47	970.89
Total	549'299.61	278'603.35
Klasse BAH1 EUR	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	7'238.74	3'454.39
Vortrag des Vorjahres	149.75	643.47
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	7'388.49	4'097.86
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	7'316.26	3'948.11
Vortrag auf neue Rechnung	72.23	149.75
Total	7'388.49	4'097.86
Klasse CTH1 EUR	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	137'630.44	78'170.84
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	137'630.44	78'170.84
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	48'170.668	27'359.79
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	9'459.78	50'811.05
Total	137'630.44	78'170.84
Klasse DAH1 EUR	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	16'777.08	11'874.79
Vortrag des Vorjahres	325.21	2'410.36
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	17'102.29	14'285.15
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	16'931.97	13'959.94
Vortrag auf neue Rechnung	170.32	325.21
Total	17'102.29	14'285.15
Klasse GTH1 EUR	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	116'008.70	111'717.27
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	116'008.70	111'717.27
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	40'603.04	39'101.04
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	75'405.66	72'616.23
Total	116'008.70	111'717.27
Klasse NT CHF	31.01.2024	
Nettoertrag	35'265.57	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	35'265.57	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'342.95	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	22'922.62	
Total	35'265.57	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							65'043'288.02	95.82	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							65'043'288.02	95.82	
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AE							0.00	0.00	
XS1205616698	2.0000 % APAAU 2 03/22/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1681520786	1.7500 % TCLAU 1 3/4 03/29/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1811198701	1.7500 % SYDAU 1 3/4 04/26/28 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.44%	256'317.00	0.38	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	150	0	0	150 EUR	103.15%	154'728.00	0.23	a)
AU							411'045.00	0.61	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	0	200	0	200 EUR	106.46%	212'922.00	0.31	a)
BE6286963051	2.3750 % BARY 2 3/8 05/24/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6321076711	1.6250 % LONNVX 1 5/8 04/21/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	100	0	100 EUR	104.00%	103'995.00	0.15	a)
BE							316'917.00	0.47	
CA07813ZCK80	5.8500 % BCECN 5.85 11/10/32	0	700	0	700 CAD	107.25%	517'315.37	0.76	a)
CA136375DG42	4.7000 % CNRCN 4.7 05/10/53	0	300	0	300 CAD	99.10%	204'849.01	0.30	a)
CA13645RAZ79	3.1500 % CP 3.15 03/13/29	0	400	0	400 CAD	94.45%	260'329.62	0.38	a)
CA775109DA61	5.9000 % RCICN 5.9 09/21/33	0	400	0	400 CAD	106.34%	293'104.01	0.43	a)
CA87971MCB78	5.6000 % TCN 5.6 09/09/30	0	500	0	500 CAD	104.91%	361'427.39	0.53	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	0	900	0	900 CAD	94.69%	587'210.96	0.87	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	0	400	0	400 USD	83.06%	305'844.94	0.45	a)
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	0	350	0	350 USD	92.55%	298'207.81	0.44	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	0	200	0	200 USD	100.16%	184'411.04	0.27	a)
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	300	0	300 USD	100.85%	278'529.76	0.41	a)
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	0	600	0	600 USD	82.80%	457'359.30	0.67	a)
XS1857683335	0.6250 % TD 0 5/8 07/20/23 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CA							3'748'589.21	5.52	
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	0	800	200	600 USD	98.66%	544'952.85	0.80	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	0	250	0	250 USD	103.43%	238'046.45	0.35	a)
USH42097EQ69	6.3010 % UBS 6.301 09/22/34 REGS	0	200	0	200 USD	106.05%	195'264.78	0.29	a)
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	0	200	0	200 USD	107.03%	197'059.95	0.29	a)
XS1875331636	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 09/17/25 EUR	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2358287238	0.0100 % UBS 0.01 06/29/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH							1'175'324.03	1.73	
DE000A14J9N8	2.2410 % ALVGR 2.241 07/07/45	500	0	200	300 EUR	97.28%	291'849.00	0.43	a)
DE000A169G15	1.4000 % MBGGR 1.4 01/12/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3823H4	4.8510 % ALVGR 4.851 07/26/54	0	400	0	400 EUR	102.82%	411'296.00	0.61	a)
DE000A3MQQV5	2.0000 % DBOERS 2 06/23/48	0	200	0	200 EUR	91.33%	182'668.00	0.27	a)
DE000CZ45V82	0.3750 % CMZB 0 3/8 09/01/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	0	300	0	300 EUR	97.92%	293'763.00	0.43	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.34%	188'684.00	0.28	a)
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	0	200	0	200 USD	83.88%	154'446.54	0.23	a)
USD5558XAA66	5.8750 % MUNRE 5 7/8 05/23/42 REGS	0	400	0	400 USD	101.51%	373'789.38	0.55	a)
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	0	200	0	200 USD	80.22%	147'706.59	0.22	a)
XS1205548164	1.6250 % WPLPL 1 5/8 03/23/30 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	0	300	0	300 EUR	85.46%	256'380.00	0.38	a)
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	500	0	0	500 EUR	92.55%	462'725.00	0.68	a)
XS2056730679	3.6250 % IFXGR 3 5/8 PERP	0	200	0	200 EUR	95.90%	191'804.00	0.28	a)
XS2177580508	0.8750 % EOANGR 0 7/8 08/20/31 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2485162163	2.2500 % EVKGR 2 1/4 09/25/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	0	300	0	300 EUR	111.51%	334'521.00	0.49	a)
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	200	0	200 EUR	107.96%	215'924.00	0.32	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	400	0	400 EUR	101.94%	407'760.00	0.60	a)
DE							3'913'316.51	5.77	
XS1071713470	2.5000 % CARLB 2 1/2 05/28/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1721760541	1.5000 % ORSTED 1 1/2 11/26/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2293075680	1.5000 % ORSTED 1 1/2 02/18/3021	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK							0.00	0.00	
ES0813211028	6.0000 % BBVASM 6 PERP	0	200	0	200 EUR	99.23%	198'468.00	0.29	a)
ES0840609053	7.5000 % CABKSM 7 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	102.48%	204'954.00	0.30	a)
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	0	200	0	200 USD	100.57%	185'176.23	0.27	a)
US05946KAM36	9.3750 % BBVASM 9 3/8 PERP	0	200	0	200 USD	106.04%	195'240.85	0.29	a)
US05946KAN19	7.8830 % BBVASM 7.883 11/15/34	0	200	0	200 USD	108.25%	199'315.78	0.29	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	0	600	0	600 USD	90.69%	500'937.45	0.74	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	0	400	200	200 USD	82.48%	151'862.83	0.22	a)
US05971KAQ22	9.6250 % SANTAN 9 5/8 PERP _	0	200	0	200 USD	107.52%	197'958.46	0.29	a)
XS1512827095	1.8750 % MRLSM 1 7/8 11/02/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1575444622	1.0000 % IBESM 1 03/07/25 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1731105612	0.8750 % SABSM 0 7/8 03/05/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1897489578	1.7500 % CABKSM 1 3/4 10/24/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2300292963	1.2500 % CLNXSM 1 1/4 01/15/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.87%	89'873.00	0.13	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2434702424	0.6250 % CABKSM 0 5/8 01/21/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2455392584	2.6250 % SABSM 2 5/8 03/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.43%	196'866.00	0.29	a)
XS2465792294	2.2500 % CLNXSM 2 1/4 04/12/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.27%	194'534.00	0.29	a)
XS2484587048	2.5920 % TELEFO 2.592 05/25/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2552369469	4.6250 % REESM 4 5/8 PERP	0	300	0	300 EUR	102.16%	306'489.00	0.45	a)
XS2580221658	4.8750 % IBESM 4 7/8 PERP EMTN	0	300	0	300 EUR	101.49%	304'458.00	0.45	a)
XS2610209129	3.7500 % ANESM 3 3/4 04/25/30 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.45%	210'896.00	0.31	a)
ES							3'137'029.60	4.62	
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI							0.00	0.00	
FR0013144201	2.5000 % TDFINF 2 1/2 04/07/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013181906	1.7500 % ICADFP 1 3/4 06/10/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013248507	1.0000 % VIEFP 1 04/03/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013258936	1.2500 % CMARK 1 1/4 05/31/24	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013324357	1.3750 % SANFP 1 3/8 03/21/30 12FX	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013428513	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 06/21/39 EMTN	300	0	200	100 EUR	71.50%	71'502.00	0.11	a)
FR0014000RR2	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	88.38%	176'754.00	0.26	a)
FR0014005EJ6	1.0000 % BNFP 1 PERP	0	200	0	200 EUR	91.79%	183'584.00	0.27	a)
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 03/02/29	200	0	0	200 EUR	92.45%	184'894.00	0.27	a)
FR001400AF72	2.3750 % ORAFP 2 3/8 05/18/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	100	0	0	100 EUR	102.40%	102'401.00	0.15	a)
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.45%	310'335.00	0.46	a)
FR001400I3C5	3.4700 % BNFP 3.47 05/22/31 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400KCC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	0	300	0	300 EUR	105.29%	315'861.00	0.47	a)
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L461	6.6250 % SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN	0	100	0	100 GBP	111.33%	130'517.57	0.19	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFPP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	105.92%	105'915.00	0.16	a)
FR001400N2U2	6.5000 % ACAFP 6 1/2 PERP	0	400	0	400 EUR	100.64%	402'560.00	0.59	a)
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.58%	100'581.00	0.15	a)
US06675GBC87	5.0880 % BFCM 5.088 01/23/27 REGS	0	600	0	600 USD	100.71%	556'270.71	0.82	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	0	400	200	200 USD	103.35%	190'280.66	0.28	a)
US83368TBW71	5.6340 % SOCGEN 5.634 01/19/30 REGS	0	300	0	300 USD	99.99%	276'141.33	0.41	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	0	200	0	200 USD	99.97%	184'062.92	0.27	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	0	200	0	200 USD	88.86%	163'609.03	0.24	a)
USF1067PAD80	9.2500 % BNP 9 1/4 PERP REGS	0	200	0	200 USD	106.70%	196'456.04	0.29	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	0	400	0	400 USD	101.31%	373'067.63	0.55	a)
USF12033TP59	2.9470 % BNFP 2.947 11/02/26 REGS	0	500	0	500 USD	95.81%	441'013.43	0.65	a)
USF2R125Q730	6.2510 % ACAFP 6.251 01/10/35 REGS	0	400	0	400 USD	102.10%	375'984.09	0.55	a)
XS1115498260	5.0000 % ORAFP 5 PERP EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1204154410	2.6250 % ACAFP 2 5/8 03/17/27	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.85%	97'852.00	0.14	a)
XS1385945131	2.3750 % BFCM 2 3/8 03/24/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1501166869	3.3690 % TTEFP 3.369 PERP EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1748456974	1.1250 % BNP 1 1/8 06/11/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2610457967	5.5000 % AXASA 5 1/2 07/11/43 EMTN	0	400	0	400 EUR	106.66%	426'636.00	0.63	a)
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	0	350	0	350 EUR	101.99%	356'979.00	0.53	a)
FR							5'723'257.41	8.43	
US404280DV88	6.2540 % HSBC 6.254 03/09/34	0	600	200	400 USD	106.15%	390'899.33	0.58	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	0	300	0	300 USD	97.01%	267'909.93	0.39	a)
US92857WBX74	5.1250 % VOD 5 1/8 06/04/2081	0	400	0	400 USD	75.52%	278'101.30	0.41	a)
USG84228FQ64	6.3010 % STANLN 6.301 01/09/29 REGS	0	400	0	400 USD	102.91%	378'963.15	0.56	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	0	100	0	100 GBP	98.72%	115'736.73	0.17	a)
XS1040506898	2.9720 % BPLN 2.972 02/27/26 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1062493934	2.8750 % AON 2 7/8 05/14/26	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1083986718	3.8750 % AVLN 3 7/8 07/03/44 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.38%	99'381.00	0.15	a)
XS1190974011	1.5730 % BPLN 1.573 02/16/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1428953407	3.1250 % HSBC 3 1/8 06/07/28 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1517174626	1.0000 % LLOYDS 1 11/09/23 EMTN	501	0	501	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1678970291	2.0000 % BACR 2 02/07/28 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1686846061	1.6250 % AALLN 1 5/8 09/18/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1788515606	1.7500 % NWG 1 3/4 03/02/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1896660989	1.0000 % DGELN 1 04/22/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2021471433	0.3750 % MOTOPG 0 3/8 01/03/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057092236	2.2500 % SSELN 2 1/4 09/27/35 EMTN	0	200	0	200 GBP	75.63%	177'327.86	0.26	a)
XS2083961370	3.7500 % LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN	0	200	0	200 GBP	89.68%	210'265.87	0.31	a)
XS2113658202	5.7500 % NWIDE 5 3/4 PERP	0	200	0	200 GBP	92.56%	217'020.88	0.32	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	0	300	150	150 GBP	93.65%	164'680.67	0.24	a)
XS2264977146	0.2000 % CCEP 0.2 12/02/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2381853279	0.2500 % NGGLN 0 1/4 09/01/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2438026440	0.8750 % THAMES 0 7/8 01/31/28	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2485268150	6.8750 % AVLN 6 7/8 PERP	0	200	0	200 GBP	93.20%	218'519.13	0.32	a)
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.69%	209'374.00	0.31	a)
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618731256	4.8740 % STANLN 4.874 05/10/31	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2641168997	5.7500 % UU 5 3/4 06/26/36 EMTN	0	200	100	100 GBP	105.67%	123'880.96	0.18	a)
XS2678308359	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 09/11/35 EMTN	0	150	0	150 GBP	106.13%	186'632.12	0.27	a)
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.97%	104'971.00	0.15	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	100	0	100 GBP	103.83%	121'720.34	0.18	a)
XS2741906809	5.3500 % NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN	0	300	0	300 GBP	99.27%	349'141.03	0.51	a)
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	0	200	0	200 GBP	104.82%	245'768.95	0.36	a)
GB							3'860'294.25	5.69	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	300	0	300 EUR	85.15%	255'444.00	0.38	a)
HK							255'444.00	0.38	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	0	600	0	600 USD	83.03%	458'621.49	0.68	a)
USG0R4HJAD89	6.6080 % AIB 6.608 09/13/29 REGS	0	200	0	200 USD	105.01%	193'340.73	0.28	a)
XS0897406814	4.2500 % ZURNVX 4 1/4 10/02/43 EMTN	102	0	102	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X51803247557	1.1250 % SCMNXX 1 1/8 10/12/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52003442436	1.2500 % AIB 1 1/4 05/28/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52231331344	1.0000 % JCI 1 09/15/32	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	0	300	0	300 USD	81.69%	225'623.72	0.33	a)
X52464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	0	200	0	200 GBP	103.62%	242'945.96	0.36	a)
X52560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.81%	100'813.00	0.15	a)
X52626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE							1'221'344.90	1.80	
X52089368596	0.7500 % ISPIM 0 3/4 12/04/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52357205587	0.3750 % TRNIM 0 3/8 06/23/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.15%	356'584.00	0.53	a)
X52437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	200	0	0	200 EUR	91.57%	183'138.00	0.27	a)
X52592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	105.77%	317'322.00	0.47	a)
X52625196352	4.8750 % ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	300	100	200 EUR	107.86%	215'724.00	0.32	a)
X52678939427	9.1250 % ISPIM 9 1/8 PERP	0	200	0	200 EUR	110.43%	220'862.00	0.33	a)
IT							1'293'630.00	1.91	
CH0336602930	1.2500 % UBS 1 1/4 09/01/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	0	400	0	400 USD	64.99%	239'300.86	0.35	a)
X5119775692	1.5000 % APTV 1 1/2 03/10/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51485603747	1.6000 % APTV 1.6 09/15/28	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JE							239'300.86	0.35	
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	0	700	500	200 USD	94.26%	173'559.92	0.26	a)
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	0	200	0	200 USD	107.83%	198'543.96	0.29	a)
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	0	500	0	500 USD	102.18%	470'335.88	0.69	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	0	400	0	400 USD	103.28%	380'308.57	0.56	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	0	200	0	200 USD	85.70%	157'783.01	0.23	a)
X51675764945	0.8720 % MUFG 0.872 09/07/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	800	0	600	200 EUR	85.47%	170'944.00	0.25	a)
X52242747348	0.5410 % ASABRE 0.541 10/23/28	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52323295563	0.0460 % NIDEC 0.046 03/30/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP							1'551'475.34	2.29	
USY8085FBL32	6.5000 % HYUELE 6 1/2 01/17/33 REGS	0	400	0	400 USD	107.02%	394'088.81	0.58	a)
KR							394'088.81	0.58	
US81180WBG50	9.6250 % STX 9 5/8 12/01/32 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	0	200	0	200 EUR	99.56%	199'126.00	0.29	a)
LI							199'126.00	0.29	
DE000A3KNP96	0.7500 % TRAGR 0 3/4 03/24/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52049422343	4.2500 % SRENVX 4 1/4 PERP	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52051149552	1.8000 % DHR 1.8 09/18/49	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	400	0	0	400 EUR	86.97%	347'880.00	0.51	a)
X52261215011	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 04/23/31	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52298459426	1.2130 % BDX 1.213 02/12/36	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	77.76%	311'032.00	0.46	a)
LU							658'912.00	0.97	
USP01703AD22	3.2500 % ALPEKA 3 1/4 02/25/31 REGS	0	300	0	300 USD	83.89%	231'677.69	0.34	a)
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
MX							231'677.69	0.34	
DE000A1919G4	1.7500 % JABHOL 1 3/4 06/25/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US456837BF96	6.0830 % INTNED 6.083 09/11/27	0	300	0	300 USD	102.04%	281'823.26	0.42	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	0	500	0	500 USD	93.24%	429'160.71	0.63	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	0	200	0	200 USD	94.72%	174'398.46	0.26	a)
X51398476793	1.1250 % IBESM 1 1/8 04/21/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1551446880	1.3750 % NTGY5M 1 3/8 01/19/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1566100977	0.3750 % UNANA 0 3/8 02/14/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1629774230	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1693822634	4.7500 % ABNAV 4 3/4 PERP	0	200	0	200 EUR	92.13%	184'250.00	0.27	a)
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	0	300	0	300 EUR	90.49%	271'482.00	0.40	a)
XS1871439342	0.7500 % RABOBK 0 3/4 08/29/23 GMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1873209172	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/04/30	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	100	0	0	100 EUR	99.10%	99'104.00	0.15	a)
XS1909186451	2.5000 % INTND 2 1/2 11/15/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056374353	0.8750 % MDLZ 0 7/8 10/01/31 REGS	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2128499105	2.3750 % LIGHT 2 3/8 05/11/27	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2170386853	1.2500 % RDSALN 1 1/4 11/11/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2177013765	0.7500 % RKTLN 0 3/4 05/19/30 REGS	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2178585423	2.1250 % CONGR 2 1/8 11/27/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	300	0	0	300 EUR	79.27%	237'810.00	0.35	a)
XS2332234413	0.1250 % SGSNVX 0 1/8 04/21/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348325494	0.5000 % TENN 0 1/2 06/09/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384726282	0.6250 % MDLZ 0 5/8 09/09/32 REGS	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406569579	0.8750 % TENN 0 7/8 06/16/35 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2432293913	1.2500 % ENELIM 1 1/4 01/17/35 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2443920249	1.2500 % INTND 1 1/4 02/16/27 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2456432413	4.8750 % RABOBK 4 7/8 PERP	0	400	0	400 EUR	91.77%	367'076.00	0.54	a)
XS2486270858	6.0000 % KPN 6 PERP	0	400	0	400 EUR	105.41%	421'640.00	0.62	a)
XS2526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.22%	408'860.00	0.60	a)
XS2530756191	3.0000 % WKLNA 3 09/23/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2585240984	7.5000 % INTND 7 1/2 PERP	0	200	0	200 USD	99.33%	182'877.19	0.27	a)
XS2590262296	5.1250 % ABNAV 5 1/8 02/22/28 EMTN	0	300	100	200 GBP	100.87%	236'498.10	0.35	a)
XS2592088400	3.3550 % ROSW 3.355 02/27/35	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592804434	7.3750 % TEVA 7 3/8 09/15/29	0	100	0	100 EUR	108.78%	108'775.00	0.16	a)
XS2646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	0	400	0	400 EUR	107.96%	431'852.00	0.64	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.27%	210'534.00	0.31	a)
XS2694995163	3.6250 % ASRND 3 5/8 12/12/28	0	100	0	100 EUR	100.79%	100'791.00	0.15	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	100	0	100 EUR	107.00%	106'996.00	0.16	a)
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.53%	104'530.00	0.15	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.66%	102'662.00	0.15	a)
XS2747181969	3.1250 % ABBNVX 3 1/8 01/15/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.68%	100'682.00	0.15	a)
NL							4'561'801.72	6.72	
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	0	200	0	200 USD	89.63%	165'026.76	0.24	a)
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	0	200	0	200 USD	98.44%	181'253.25	0.27	a)
NO							346'280.01	0.51	
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	0	400	0	400 USD	101.74%	374'662.11	0.55	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	0	400	0	400 USD	101.53%	373'863.02	0.55	a)
XS1962595895	0.7500 % ASBBNK 0 3/4 03/13/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NZ							748'525.13	1.10	
PTBSSIOM0015	1.8750 % BRCORO 1 7/8 04/30/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPL 5.943 04/23/2083 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.10%	208'190.00	0.31	a)
PTEDPROM0029	1.8750 % EDPL 1 7/8 08/02/2081	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PT							208'190.00	0.31	
XS1205618470	3.0000 % VATFAL 3 03/19/2077	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1788951090	0.5000 % SEB 0 1/2 03/13/23 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1842961440	0.8750 % NDASS 0 7/8 06/26/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1971935223	2.1250 % VOVCAB 2 1/8 04/02/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2447983813	1.3750 % SHBASS 1 3/8 02/23/29 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52486825669	4.2500 % VOV CAB 4 1/4 05/31/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52526881532	4.6250 % TELIAS 4 5/8 12/21/2082	0	300	0	300 EUR	100.54%	301'608.00	0.44	a)
SE							301'608.00	0.44	
US24023NAA00	4.5200 % DBSSP 4.52 12/11/28 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US716973AE24	4.7500 % PFE 4 3/4 05/19/33	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	200	0	200 USD	101.27%	186'454.08	0.27	a)
SG							186'454.08	0.27	
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	0	600	0	600 USD	71.21%	393'336.56	0.58	a)
US00206RMT67	5.4000 % T 5.4 02/15/34	0	300	0	300 USD	102.61%	283'390.63	0.42	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	0	100	0	100 USD	93.15%	85'758.16	0.13	a)
US00287YCB39	4.2500 % ABBV 4 1/4 11/21/49	0	600	0	600 USD	87.83%	485'131.15	0.71	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	0	400	0	400 USD	77.45%	285'192.20	0.42	a)
US025816CW76	4.0500 % AXP 4.05 05/03/29	0	500	0	500 USD	98.70%	454'301.89	0.67	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	0	500	0	500 USD	92.98%	427'966.60	0.63	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	0	300	0	300 USD	98.35%	271'627.46	0.40	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	0	300	0	300 USD	72.19%	199'366.67	0.29	a)
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	0	500	0	500 USD	102.11%	470'005.20	0.69	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	0	100	0	100 USD	103.09%	94'906.15	0.14	a)
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	0	300	0	300 USD	94.65%	261'402.46	0.39	a)
US036752AW30	5.5000 % ELV 5 1/2 10/15/32	0	100	0	100 USD	103.75%	95'515.63	0.14	a)
US03740LAF94	5.0000 % AON 5 09/12/32	0	400	0	400 USD	100.00%	368'256.09	0.54	a)
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	0	200	0	200 USD	96.89%	178'402.87	0.26	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	0	200	0	200 USD	96.76%	178'150.71	0.26	a)
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	0	500	0	500 USD	94.62%	435'556.09	0.64	a)
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	0	500	0	500 USD	104.44%	480'756.52	0.71	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	0	300	0	300 USD	92.52%	255'527.37	0.38	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	0	200	0	200 USD	82.96%	152'743.42	0.23	a)
US110122CQ99	4.1250 % BYM 4 1/8 06/15/39	0	400	0	400 USD	89.95%	331'221.24	0.49	a)
US11135FBR10	4.0000 % AVGO 4 04/15/29 144A	0	100	0	100 USD	96.22%	88'581.01	0.13	a)
US11135FBV22	4.9260 % AVGO 4.926 05/15/37 144A	0	400	0	400 USD	96.35%	354'785.10	0.52	a)
US126408HV80	4.5000 % CSX 4 1/2 11/15/52	0	400	200	200 USD	91.06%	167'667.16	0.25	a)
US126650DS68	5.0000 % CVS 5 02/20/26	0	700	0	700 USD	100.26%	646'094.94	0.95	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	200	0	200 USD	99.19%	182'630.27	0.27	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	0	300	0	300 USD	95.77%	264'495.93	0.39	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	50	0	50 USD	102.14%	47'015.65	0.07	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	0	200	0	200 USD	104.02%	191'516.21	0.28	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	0	200	0	200 USD	98.48%	181'324.26	0.27	a)
US17327CAN39	2.0140 % C 2.014 01/25/26	0	400	0	400 USD	96.54%	355'487.35	0.52	a)
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	0	250	0	250 USD	60.15%	138'424.70	0.20	a)
US20030NEC11	4.6500 % CMCSA 4.65 02/15/33	0	700	0	700 USD	99.62%	641'969.49	0.95	a)
US22822VBA89	5.0000 % CCI 5 01/11/28	0	400	0	400 USD	99.60%	366'761.74	0.54	a)
US237266AJ06	6.0000 % DAR 6 06/15/30 144A	0	200	0	200 USD	99.38%	182'974.71	0.27	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	0	100	0	100 USD	102.12%	94'007.67	0.14	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	0	400	0	400 USD	104.82%	386'007.36	0.57	a)
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	0	400	0	400 USD	99.62%	366'830.49	0.54	a)
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	0	200	0	200 USD	91.33%	168'153.20	0.25	a)
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	0	300	0	300 USD	92.52%	255'514.44	0.38	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	0	100	0	100 USD	93.70%	86'262.34	0.13	a)
US337738BH05	5.6250 % FI 5 5/8 08/21/33	0	200	0	200 USD	104.10%	191'674.18	0.28	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	0	400	0	400 USD	82.82%	304'965.50	0.45	a)
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	0	400	0	400 USD	114.11%	420'211.28	0.62	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	0	500	0	500 USD	101.61%	467'715.09	0.69	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	0	300	0	300 USD	93.14%	257'244.27	0.38	a)
US38145GAH39	3.5000 % GS 3 1/2 11/16/26	0	500	0	500 USD	96.72%	445'179.81	0.66	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	0	200	0	200 USD	94.51%	174'003.64	0.26	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	0	150	0	150 USD	93.73%	129'426.86	0.19	a)
US42824CBP32	5.2500 % HPE 5 1/4 07/01/28	0	400	0	400 USD	101.61%	374'158.82	0.55	a)
US437076AS19	5.8750 % HD 5 7/8 12/16/36	0	300	0	300 USD	110.73%	305'802.83	0.45	a)
US458140CF51	5.1250 % INTC 5 1/8 02/10/30	0	400	0	400 USD	103.02%	379'369.27	0.56	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	0	400	0	400 USD	100.11%	368'632.10	0.54	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	0	100	0	100 USD	98.16%	90'364.63	0.13	a)
US459506AK78	4.4500 % IFF 4.45 09/26/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HRS12	3.2000 % JPM 3.2 06/15/26	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCM68	0.7680 % JPM 0.768 08/09/25	0	200	0	200 USD	97.43%	179'391.80	0.26	a)
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	0	400	0	400 USD	101.48%	373'678.10	0.55	a)
US46647PDW32	6.0700 % JPM 6.07 10/22/27	0	400	0	400 USD	102.82%	378'641.87	0.56	a)
US46647PEC68	5.3360 % JPM 5.336 01/23/35	0	400	0	400 USD	101.75%	374'683.87	0.55	a)
US478160CE22	2.9500 % JNJ 2.95 03/03/27	0	450	0	450 USD	96.51%	399'814.74	0.59	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	0	500	0	500 USD	92.53%	425'929.38	0.63	a)
US532457CF35	4.7000 % LLY 4.7 02/27/33	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	0	100	0	100 USD	103.75%	95'509.11	0.14	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	0	300	0	300 USD	102.02%	281'764.76	0.42	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	0	500	0	500 USD	101.40%	466'725.79	0.69	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	0	500	300	200 USD	82.56%	152'013.73	0.22	a)
US577081BE10	3.3750 % MAT 3 3/8 04/01/26 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59156RBN70	4.0500 % MET 4.05 03/01/45	0	600	0	600 USD	86.36%	477'015.15	0.70	a)
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	0	300	0	300 USD	83.83%	231'517.94	0.34	a)
US595112CB74	5.8750 % MU 5 7/8 09/15/33	0	300	0	300 USD	104.00%	287'235.93	0.42	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	0	700	0	700 USD	101.26%	652'512.96	0.96	a)
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	0	200	0	200 USD	97.32%	179'194.77	0.26	a)
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	600	0	600 USD	106.64%	589'052.59	0.87	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	0	250	0	250 USD	100.44%	231'170.05	0.34	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	0	400	0	400 USD	101.16%	372'511.58	0.55	a)
US68389XBZ78	3.6500 % ORCL 3.65 03/25/41	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	0	400	0	400 USD	95.66%	352'251.63	0.52	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	0	400	0	400 USD	88.00%	324'050.02	0.48	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	0	200	0	200 USD	87.32%	160'775.87	0.24	a)
US747525BT99	6.0000 % QCOM 6 05/20/53	0	300	0	300 USD	113.42%	313'246.50	0.46	a)
US756109BS20	4.7000 % O 4.7 12/15/28	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US75884RBA05	3.7000 % REG 3.7 06/15/30	0	300	0	300 USD	92.70%	256'021.51	0.38	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	0	400	0	400 USD	88.96%	327'571.63	0.48	a)
US828807DX23	6.6500 % SPG 6.65 01/15/54	0	300	0	300 USD	117.78%	325'295.23	0.48	a)
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	0	400	0	400 USD	104.58%	385'090.86	0.57	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	400	0	400 USD	101.01%	371'943.29	0.55	a)
US87264ACV52	5.2000 % TMUS 5.2 01/15/33	0	100	0	100 USD	101.70%	93'625.12	0.14	a)
US87264ACW36	5.6500 % TMUS 5.65 01/15/53	0	700	0	700 USD	103.07%	664'199.35	0.98	a)
US883556CX89	5.0860 % TMO 5.086 08/10/33	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US883556CY62	5.4040 % TMO 5.404 08/10/43	0	200	0	200 USD	104.51%	192'425.13	0.28	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	0	150	0	150 USD	82.23%	113'547.26	0.17	a)
US907818GC65	4.9500 % UNP 4.95 09/09/52	0	400	100	300 USD	99.60%	275'088.16	0.41	a)
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEU21	4.2500 % UNH 4 1/4 01/15/29	0	950	300	650 USD	99.15%	593'277.08	0.87	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	0	600	0	600 USD	73.05%	403'482.66	0.59	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	0	550	0	550 USD	70.73%	358'145.47	0.53	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	0	200	0	200 USD	96.60%	177'863.10	0.26	a)
US928563AL97	2.2000 % VMW 2.2 08/15/31	0	300	0	300 USD	82.51%	227'879.78	0.34	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	0	100	0	100 USD	87.66%	80'698.09	0.12	a)
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	0	300	0	300 USD	96.33%	266'047.54	0.39	a)
US95040QAF19	4.9500 % WELL 4.95 09/01/48	0	300	0	300 USD	93.85%	259'188.48	0.38	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	0	400	0	400 USD	102.97%	379'158.70	0.56	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	0	300	0	300 USD	103.30%	285'282.89	0.42	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	500	0	500 USD	107.53%	494'946.78	0.73	a)
XS1034975406	3.0000 % JPM 3 02/19/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1138360166	2.1250 % WBA 2 1/8 11/20/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1180256528	1.7500 % MS 1 3/4 01/30/25 GMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1240751062	1.6250 % LLY 1 5/8 06/02/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1319820541	1.6250 % FDX 1 5/8 01/11/27	325	0	325	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403264291	1.7500 % MCD 1 3/4 05/03/28 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403264374	1.0000 % MCD 1 11/15/23 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1405775534	1.3750 % TMO 1 3/8 09/12/28	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405780617	1.8750 % RVTY 1 7/8 07/19/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405784015	2.2500 % KHC 2 1/4 05/25/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1412266907	1.6500 % JNJ 1.65 05/20/35	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1492691008	1.1250 % CE 1 1/8 09/26/23	137	0	137	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1520899532	1.3750 % ABBV 1 3/8 05/17/24	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1529859321	1.0000 % ECL 1 01/15/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1591781452	1.3750 % AMT 1 3/8 04/04/25	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1708161291	1.3750 % VZ 1 3/8 10/27/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1720642138	0.6250 % TOYOTA 0 5/8 11/21/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1811435251	1.6620 % BAC 1.662 04/25/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843434280	1.1250 % FI 1 1/8 07/01/27	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843436228	1.5000 % FIS 1 1/2 05/21/27	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843459782	1.8000 % IFF 1.8 09/25/26	525	0	525	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1900752814	1.2000 % PG 1.2 10/30/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1907120528	1.8000 % T 1.8 09/05/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1944456109	0.8750 % IBM 0 7/8 01/31/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1958648294	1.3750 % CL 1 3/8 03/06/34 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010032881	0.8750 % NDAQ 0 7/8 02/13/30	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2058557344	1.8750 % TMO 1 7/8 10/01/49 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2125913942	1.5000 % ABBV 1 1/2 11/15/23	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2176561095	1.8500 % VZ 1.85 05/18/40	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242633332	1.0500 % PEP 1.05 10/09/50	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343510520	0.5000 % K 0 1/2 05/20/29	0	100	0	100 EUR	86.48%	86'481.00	0.13	a)
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	300	0	0	300 EUR	82.81%	248'436.00	0.37	a)
XS2386186063	0.5000 % LLY 0 1/2 09/14/33	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2386186576	1.1250 % LLY 1 1/8 09/14/51	300	0	200	100 EUR	63.55%	63'550.00	0.09	a)
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	200	0	0	200 EUR	81.19%	162'378.00	0.24	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2446386356	2.1030 % MS 2.103 05/08/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2479941499	1.5000 % V 1 1/2 06/15/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2484340075	2.7500 % PPG 2 3/4 06/01/29	150	0	0	150 EUR	97.50%	146'251.50	0.22	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	0	100	0	100 EUR	105.35%	105'350.00	0.16	a)
XS2625194811	4.6250 % PLD 4 5/8 05/23/33	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US							29'905'680.12	44.06	
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	0	500	0	500 USD	98.63%	453'976.35	0.67	a)
XS							453'976.35	0.67	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/USD	Verfall 04.09.2023	30'050'000	27'685'646	USD/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 04.09.2023	1'310'000	1'529'409	GBP/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 04.09.2023	1'950'000	1'327'868	CAD/EUR	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 05.09.2023	27'620'707	30'500'000	EUR/USD	0.00	0.00
CAD/EUR	Verfall 05.09.2023	1'342'117	1'950'000	EUR/CAD	0.00	0.00
GBP/EUR	Verfall 05.09.2023	1'538'230	1'320'000	EUR/GBP	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 05.09.2023	200'000	181'210	USD/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 05.09.2023	250'000	229'429	USD/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 05.09.2023	10'000	11'729	GBP/EUR	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 03.10.2023	27'942'444	30'370'000	EUR/USD	0.00	0.00
GBP/EUR	Verfall 03.10.2023	1'539'184	1'320'000	EUR/GBP	0.00	0.00
CAD/EUR	Verfall 03.10.2023	1'340'175	1'970'000	EUR/CAD	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.10.2023	300'000	279'961	USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.10.2023	20'000	13'909	CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 03.10.2023	170'000	161'703	USD/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.10.2023	10'000	7'037	CAD/EUR	0.00	0.00
EUR/GBP	Verfall 03.10.2023	1'320'000	1'521'719	GBP/EUR	0.00	0.00
EUR/CAD	Verfall 03.10.2023	1'940'000	1'355'383	CAD/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	EUR/USD Verfall 03.10.2023		29'900'000	28'242'184		USD/EUR	0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 02.11.2023		1'531'619	1'330'000		EUR/GBP	0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 02.11.2023		1'347'270	1'930'000		EUR/CAD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.11.2023		27'358'207	29'000'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.11.2023		250'000	238'019		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.11.2023		300'000	284'426		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.11.2023		200'000	189'684		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.11.2023		200'000	188'106		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.11.2023		1'930'000	1'315'189		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.11.2023		28'050'000	26'536'115		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.11.2023		1'330'000	1'526'823		GBP/EUR	0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.12.2023		1'327'676	1'950'000		EUR/CAD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.12.2023		26'643'689	28'200'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.12.2023		1'536'595	1'340'000		EUR/GBP	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.12.2023		28'200'000	25'844'293		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.12.2023		1'950'000	1'318'040		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.12.2023		1'340'000	1'554'723		GBP/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.01.2024		26'914'316	29'410'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 04.01.2024		1'364'067	2'020'000		EUR/CAD	0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 04.01.2024		1'610'849	1'390'000		EUR/GBP	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.01.2024		600'000	555'949		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 04.01.2024		1'390'000	1'603'944		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 04.01.2024		28'810'000	26'078'298		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 04.01.2024		2'020'000	1'386'710		CAD/EUR	0.00	0.00	
	GBP/EUR Verfall 02.02.2024		1'681'858	1'459'000		EUR/GBP	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.02.2024		27'133'935	30'011'000		EUR/USD	0.00	0.00	
	CAD/EUR Verfall 02.02.2024		1'441'193	2'101'000		EUR/CAD	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.02.2024		8'000	9'256		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		189'000	173'124		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.02.2024		10'000	11'606		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.02.2024		15'000	10'250		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		204'000	185'649		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.02.2024		7'000	8'142		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.02.2024		14'000	9'543		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		426'000	392'407		USD/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		395'279	372'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.02.2024		13'000	15'176		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.02.2024		49'000	33'433		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		159'000	146'048		USD/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		43'349	41'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		3'000	3'171		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 02.02.2024		218'315	35'000'000		EUR/JPY	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		232'000	212'322		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 02.02.2024		35'000'000	220'427		JPY/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CAD Verfall 02.02.2024		2'023'000	1'394'038		CAD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP Verfall 02.02.2024		1'421'000	1'665'963		GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 02.02.2024		28'801'000	26'515'375		USD/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		410'000	439'985		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/EUR Verfall 04.03.2024		221'207	35'000'000		EUR/JPY	0.00	0.00	b)
	CAD/EUR Verfall 04.03.2024		1'340'438	1'947'000		EUR/CAD	0.00	0.00	b)
	GBP/EUR Verfall 04.03.2024		1'622'029	1'385'000		EUR/GBP	0.00	0.00	b)
	USD/EUR Verfall 04.03.2024		26'337'372	28'645'000		EUR/USD	0.00	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		452'703	421'000		EUR/CHF	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'007'320.71	2.96
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	65'043'288.02	95.82
Sonstige Vermögenswerte	829'535.55	1.22
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	67'880'144.28	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-32'647.17	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	67'847'497.11	

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);	65'043'288.02	95.82

		Kurswert EUR	in % (7)
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

CAD	1 = EUR	0.68904607
CHF	1 = EUR	1.07314799
GBP	1 = EUR	1.17233807
JPY	100 = EUR	0.62979300
USD	1 = EUR	0.92060000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	30'008'070.78	44.229

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

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	-	-	-	-

6 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.

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

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

Periode: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DAH1 EUR	0.380	0.700	0.280	0.100	4.000
GTH1 EUR	0.300	0.600	0.200	0.100	4.000

Periode: 01.08.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DAH1 EUR	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
GTH1 EUR	0.430	0.600	0.330	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.

8 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AAH1 EUR	Ja	EUR	2.05000	0.71750	1.33250
BAH1 EUR	Ja	EUR	2.15000	0.75250	1.39750
DAH1 EUR	Ja	EUR	2.25000	0.78750	1.46250

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CTH1 EUR	Ja	EUR	2.264	0.792	1.472
GTH1 EUR	Ja	EUR	2.854	0.998	1.856
NT CHF	Ja	EUR	0.13622	0.04767	0.08855

12 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.

13 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 zu-zurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse 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 Anteils-klassen 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 Kapital-erträgen 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) Bond Fund Corporate

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF

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

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR

(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.

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR wird angepasst, vgl. Ziff. 1 dieser Mitteilung.

Die Anlagepolitik erfährt generell und bezogen auf die Teilvermögen Anpassungen und Ergänzungen, vgl. Ziff. 2 der Mitteilung.

Das Klassenkonzept wird angepasst, vgl. Ziff. 3 dieser Mitteilung.

Schliesslich erfolgt betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen eine Präzisierung, vgl. Ziff. 4 dieser Mitteilung.

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

1. Namensänderung

Bezeichnung bisher	Bezeichnung neu
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR	Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst, vgl. § 1 Ziff. 1, § 6 Ziff. 4 Überschrift zum Klassenkonzept dieses Teilvermögens, § 12 Überschrift zu den Ziff. 9 bis 19, § 19 Ziff. 1 sowie § 20 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages.

Die Namensänderung bringt die Repositionierung des Teilvermögens zum Ausdruck, welche unter Ziff. 2.2 und Ziff. 2.3 dieser Mitteilung erläutert wird.

2. Anpassung Anlagepolitik

2.1. Generelle Anpassungen

Neu wird § 8 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages mit der Überschrift "Zulässige Anlagen" und § 8 Ziff. 2 Bst. d des geänderten Fondsvertrages mit der Überschrift "Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters" versehen.

Die Bestimmung unter § 8 Ziff. 2 Bst. e des geänderten Fondsvertrages wird neu in § 8 Ziff. 3 eingeordnet und mit der Überschrift "Liquiditätsmanagement" versehen.

2.2. Teilfondsspezifische Anpassungen

Unter § 8 Ziff. 2 ist die Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen dargelegt. Unter § 8 Ziff. 2 Bst. a wird die Vermögensallokation für mindestens zwei Drittel des Vermögens der Teilvermögen definiert.

Die Anlageinstrumente Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte (inkl. Contingent Convertible Bonds) werden neu unter Forderungswertpapieren und -wertrechten eingeordnet. Zudem werden bei der beispielhaften Aufzählung neu auch Bail-in Bonds als zulässige Anlage aufgeführt und die Reihenfolge geändert, vgl § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Bezogen auf Ziff. 1 dieser Mitteilung bringt die neue Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) zum Ausdruck, dass das Teilvermögen weiterhin global in Unternehmensanleihen investiert, jedoch keine Beschränkung mehr auf Anleihen hat, die auf die Rechnungswährung des Teilvermögens lauten, welche bei diesem Teilvermögen der Euro (EUR) ist. Die Beschränkung auf die Rechnungswährung wird ersatzlos gestrichen, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF investieren ebenfalls global in Unternehmensanleihen, jedoch werden bei diesen Anleihen die Risiken von Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung abgesichert. Die Rechnungswährung dieser beiden Teilvermögen ist der Schweizer Franken (CHF). Neu wird in der Bestimmung die Rechnungswährung Schweizer Franken (CHF) explizit erwähnt, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. aa des geänderten Fondsvertrages.

Weiter wird betreffend indirekten Anlagen über strukturierte Produkte betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) die Auflage gestrichen, dass diese auf die Rechnungswährung lauten müssen. Auch bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF wird die Auflage gestrichen, dass diese gegen die Risiken von Wechselkursschwankungen zwischen Anlagewährung und Rechnungswährung abgesichert sein müssen, vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. ad des geänderten Fondsvertrages.

Die angepasste Bestimmung von § 8 Ziff. 2 Bst. a des geänderten Fondsvertrages lautet 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. "

2.3. Ergänzung um Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable"

Bezogen auf Ziff. 1 und Ziff. 2.2 dieser Mitteilung bringt die Namensänderung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) zusätzlich zum Ausdruck, dass bei diesem Teilvermögen die Titelauswahl nicht mehr nach der Nachhaltigkeitspolitik "Responsible", sondern neu nach der Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" erfolgen wird.

Das hat zur Folge, dass die bestehende Bestimmung unter § 8 Ziff. 2 Bst. d in Bst. da Nachhaltigkeitspolitik "Responsible" und in Bst. db Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" unterteilt wird.

Unter Bst. da wird neu darauf hingewiesen, dass der Vermögensverwalter diese Nachhaltigkeitspolitik nicht mehr für jedes der Teilvermögen anwendet, sondern für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate hedged CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate Short Duration hedged CHF. Ansonsten wird an der Nachhaltigkeitspolitik "Responsible" nichts geändert.

Unter Bst. db wird die Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" aufgeführt, welche der Vermögensverwalter neu beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) anwenden wird.

Die Nachhaltigkeitspolitik "Sustainable" lautet wie folgt, vgl. § 8 Ziff. 2 lit. db des geänderten Fondsvertrages:

*"Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate wendet der Vermögensverwalter eine Nachhaltigkeitspolitik an, welche **Ausschlüsse, Anlagen in SDG Titel**, einen **Best-in-Class-Ansatz**, einen **ESG-Integration-Ansatz** und die Ausrichtung auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** beinhaltet.*

*Der Vermögensverwalter legt umfangreiche **Ausschlusskriterien** fest. Die anwendbaren Ausschlusskriterien werden im Prospekt aufgeführt.*

*Der Vermögensverwalter fokussiert sich zudem auf Titel von Unternehmungen und zweckgebundene Finanzierungen (zum Beispiel Social, Green oder Sustainable Bonds), die gemäss Einschätzung des Vermögensverwalters einen Beitrag zur Erfüllung von wesentlichen Nachhaltigkeitszielen mit Bezug zu einem oder mehreren der 17 Nachhaltigkeitsziele der Vereinten Nationen (UN Sustainable Development Goals, UN SDGs) leisten (**Anlagen in SDG Titel**). Weitergehende Informationen zu den Anlagen in SDG Titel werden im Prospekt angegeben.*

*Zwecks Diversifikation kann der Vermögensverwalter zudem in Titel investieren, die er hinsichtlich der Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) als überdurchschnittlich positiv einschätzt (**Best-in-Class-Ansatz**). Weitergehende Informationen zum Best-in-Class-Ansatz werden im Prospekt angegeben.*

*Bei der Auswahl von Anlagen, welche nach Massgabe der SDG Analyse oder des Best-in-Class-Ansatzes als investierbar gelten, werden vom Vermögensverwalter schliesslich Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) systematisch berücksichtigt (**ESG-Integration-Ansatz**). Weitergehende Informationen zum ESG-Integration-Ansatz werden im Prospekt angegeben.*

*Des Weiteren richtet der Vermögensverwalter die Anlagetätigkeit auf eine kontinuierliche **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zur CO₂e-Intensität der Anlagen im Referenzindex per Ende 2019 aus. Weitere Informationen zur Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen finden sich im Prospekt.*

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten). Weitere Informationen finden sich im Prospekt bei den Erläuterungen der einzelnen Nachhaltigkeitsaspekte.

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik bei allen Anlagen angewendet wird. Der Vermögensverwalter behält sich dabei jedoch im Umfang von höchstens 33% des Vermögens des Teilvermögens vor, die Nachhaltigkeitspolitik oder einzelne Elemente der Nachhaltigkeitspolitik bei geldnahen Mitteln (einschliesslich flüssige Mittel) und/oder beim Einsatz von Derivaten auf Finanzindizes in Zusammenhang mit der Bewirtschaftung von Zeichnungen von Fondsanteilen durch Anleger und/oder beim Einsatz von engagementreduzierenden Derivaten nicht anzuwenden. 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 (mit Ausnahme von engagementerhöhenden Derivaten, denen Beteiligungs- oder Forderungstitel von einzelnen Unternehmungen zugrunde liegen) aus Praktikabilitätsgründen überdies vor, die Nachhaltigkeitspolitik ebenfalls nicht anzuwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben überdies, dass die vorerwähnten Ausnahmen insgesamt 39% des Vermögens des Teilvermögens nicht übersteigen dürfen.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Verbesserung des Rendite-/Risikoprofils, die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit) sowie die Leistung eines Beitrages zu wesentlichen Nachhaltigkeitszielen.

Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik."

3. Anpassung Klassenkonzept

Fünf lancierte Anteilklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Corporate (bisher Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate EUR) werden auf Anteilklassen mit einer systematischen Währungsabsicherung umgestellt. Das heisst, dass neu bei diesen Anteilklassen Währungsschwankungen zwischen der Referenzwährung dieser Anteilklassen EUR und den Anlagewährungen des Teilvermögens abgesichert werden. Aufgrund von Marktschwankungen oder aus Kostenüberlegungen des Vermögensverwalters kann es zu einer Über- oder Unterbesicherung kommen.

Diese Währungsabsicherung kommt in der geänderten Bezeichnung der Anteilklassen an dritter und vierter Stelle der Bezeichnung zum Ausdruck, indem die Bezeichnung dieser Anteilklasse um "H1" ergänzt wird. Somit lauten die Bezeichnungen dieser Anteilklassen bisher und neu wie folgt, vgl. § 6 Ziff. 4 und § 19 Ziff. 1 des geänderten Fondsvertrages:

Bezeichnung bisher	Bezeichnung neu
AA EUR	AAH1 EUR
BA EUR	BAH1 EUR
CT EUR	CTH1 EUR
DA EUR	DAH1 EUR
GT EUR	GTH1 EUR

4. Präzisierung Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Betreffend die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen wird mit Bezug auf die Tabelle am Ende des Prospektes eine Präzisierung vorgenommen. Der Text lautet neu wie folgt, vgl. neuen Wortlaut unter § 17 Ziff. 1 und erster Abschnitt von Ziff. 2 des geänderten Fondsvertrages:

- "1. Zeichnungs- und Rücknahmeanträge für Anteile werden an jedem Bankwerktag (Auftragstag) bis zu einem bestimmten in der Tabelle am Ende des Prospektes genannten Zeitpunkt von der Depotbank entgegengenommen. Der für die Ausgabe und Rücknahme massgebende Preis der Anteile wird frühestens an dem auf den Auftragstag folgenden Bankwerktag (Bewertungstag) ermittelt (Forward Pricing). In der Tabelle am Ende des Prospektes sind die Einzelheiten geregelt.

2. *Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gemäss § 16 berechneten Nettoinventarwert je Anteil. Bei der Ausgabe von Anteilen kann zum Nettoinventarwert eine Ausgabekommission gemäss § 18 zugeschlagen werden.*"

* * *

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 von den Ziff. 1, Ziff. 2 und Ziff. 3 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 Fondsvertrages in bar verlangen können.

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

Zürich, 8. Juni 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich