

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE CHF

Jahresbericht per 31.01.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	277966	CHF
BA CHF	20594630	CHF
CT CHF	37873018	CHF
DT CHF	125029384	CHF
GT CHF	123508057	CHF
NT CHF	124627677	CHF

Rechnungswährung: CHF

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 Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate CHF, bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Januar 2024, 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.



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 2024, 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	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	14
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	14
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
8	Pauschale Verwaltungskommission	16
9	Benchmark	16
10	TER	17
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	17
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	17
13	Fussnoten	17
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18
15	Pflichtpublikationen	20

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					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		136'087'747.88	74'930'967.71	80'076'659.18	96'757'827.80
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		60'575'693.35	61'748'111.50	76'817'498.74	92'643'836.05
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		654'615.199	694'234.569	805'042.075	952'393.705
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.5363	88.9442	95.4205	97.2700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.2032	88.6329	95.3155	97.1700
Ausschüttung je Anteil		0.35	-	-	0.20
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'518'364.21	1'986'590.20	2'145'230.17	2'112'219.23
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		25'937.302	21'284.835	21'379.092	20'697.543
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		97.0943	93.3336	100.3424	102.0500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.7448	93.0069	100.2321	101.9400
Ausschüttung je Anteil		0.70	0.40	0.60	0.40
Total Expense Ratio (TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'285'770.84	784'364.38	1'113'930.27	2'001'772.52
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'990.523	8'269.981	10'978.808	19'449.969
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.9776	94.8448	101.4619	102.9200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		98.6213	94.5128	101.3503	102.8100
Thesaurierung je Anteil		0.76	0.47	0.53	0.55
Total Expense Ratio (TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'243'393.80			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		88'399.100			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		104.5643			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		104.1879			
Thesaurierung je Anteil		0.81			
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %			
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'928'243.42	10'411'901.63		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		95'234.840	104'545.496		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		104.2501	99.5921		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.8748	99.2435		
Thesaurierung je Anteil		0.97	0.10		
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %		

	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		52'536'282.26			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		506'482.567			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode (1)		103.7277			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.3543			
Thesaurierung je Anteil		1.36			
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 AA CHF	4.03 %	5.94 %	-9.68 %	-0.51 %
Klasse BA CHF	4.47 %	6.39 %	-9.31 %	-0.09 %
Klasse CT CHF	4.53 %	6.45 %	-9.25 %	-0.03 %
Klasse DT CHF (Lancierung 28.02.2023)	4.95 %	4.95 %	-	-
Klasse GT CHF (Lancierung 07.12.2022)	4.72 %	6.54 %	-1.73 %	-
Klasse NT CHF (Lancierung 02.02.2023)	4.11 %	4.06 %	-	-

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	1'851'742.46	2'566'663.11
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	132'525'838.90	71'685'020.00
Derivative Finanzinstrumente	621'581.83	174'923.13
Sonstige Vermögenswerte	1'155'377.29	566'539.74
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	136'154'540.48	74'993'145.98
Andere Verbindlichkeiten	-66'792.60	-62'178.27
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	136'087'747.88	74'930'967.71

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		694'234.569	805'042.075
Ausgegebene Anteile		42'315.354	5'767.251
Zurückgenommene Anteile		-81'934.724	-116'574.757
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		654'615.199	694'234.569

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		21'284.835	21'379.092
Ausgegebene Anteile		6'612.467	-
Zurückgenommene Anteile		-1'960.000	-94.257
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		25'937.302	21'284.835

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'269.981	10'978.808
Ausgegebene Anteile		8'573.479	1'040.000
Zurückgenommene Anteile		-3'852.937	-3'748.827
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'990.523	8'269.981

	von bis	Lancierung 28.02.2023 31.01.2024	
Klasse DT CHF			
Ausgegebene Anteile		96'516.100	
Zurückgenommene Anteile		-8'117.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		88'399.100	

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	Lancierung 07.12.2022 31.01.2023
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		104'545.496	-
Ausgegebene Anteile		3'177.223	106'094.365
Zurückgenommene Anteile		-12'487.879	-1'548.869
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		95'234.840	104'545.496

	von bis	Lancierung 02.02.2023 31.01.2024	
Klasse NT CHF			
Ausgegebene Anteile		506'482.567	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		506'482.567	

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		74'930'967.71	80'076'659.18
Ausbezahlte Ausschüttung		-9'565.93	-12'827.46
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'400.58	-1'983.54
Saldo aus dem Anteilverkehr		55'754'040.13	113'005.60
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		5'417'706.55	-5'243'886.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		136'087'747.88	74'930'967.71

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		20'855.15	759.74
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-5'069.32
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'661'177.24	744'236.71
Erträge aus Wertpapierleihe		26'994.55	15'678.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		78'810.87	3'849.14
Total Ertrag		1'787'837.81	759'455.02
Aufwand			
Passivzinsen		-61.77	-26.50
Reglementarische Vergütungen		-696'266.78	-724'000.35
Sonstige Aufwendungen		0.00	-10.60
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-29'556.20	-10'422.95
Total Aufwand		-725'884.75	-734'460.40
Nettoertrag / Verlust		1'061'953.06	24'994.62
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		150'236.52	-1'814'981.17
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		258'629.56	75'912.86
Realisierter Erfolg		1'470'819.14	-1'714'073.69
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		3'946'887.41	-3'529'812.38
Gesamterfolg		5'417'706.55	-5'243'886.07

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	180'209.80	999.79
Vortrag des Vorjahres	67'617.34	66'617.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	247'827.14	67'617.34
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	229'115.32	0.00
Vortrag auf neue Rechnung	18'711.82	67'617.34
Total	247'827.14	67'617.34
Klasse BA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	17'986.97	8'700.57
Vortrag des Vorjahres	343.09	156.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'330.06	8'857.02
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	18'156.11	8'513.93
Vortrag auf neue Rechnung	173.95	343.09
Total	18'330.06	8'857.02
Klasse CT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	9'885.80	3'902.30
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	9'885.80	3'902.30
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'460.03	1'365.81
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'425.77	2'536.49
Total	9'885.80	3'902.30
Klasse DT CHF	31.01.2024	
Nettoertrag	72'433.98	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	72'433.98	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	25'351.89	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	47'082.09	
Total	72'433.98	
Klasse GT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	92'598.51	11'391.96
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	92'598.51	11'391.96
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	32'409.48	3'987.19
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	60'189.03	7'404.77
Total	92'598.51	11'391.96
Klasse NT CHF	31.01.2024	
Nettoertrag	688'838.00	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	688'838.00	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	241'093.30	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	447'744.70	
Total	688'838.00	

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 CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							132'525'838.90	97.33	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							132'525'838.90	97.33	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.40%	944'000.00	0.69	a)
AE							944'000.00	0.69	
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	87.95%	879'500.00	0.65	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.75	a)
AT							1'902'500.00	1.40	
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.65%	986'500.00	0.72	a)
CH0472691408	0.8000 % AMPAU 0.8 07/18/23 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.69	a)
AU							1'922'500.00	1.41	
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.20%	932'000.00	0.68	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.75	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.75	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	1'000	500	0	1'500 CHF	101.70%	1'525'500.00	1.12	a)
CA							4'506'500.00	3.31	
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'000	0	0	1'000 CHF	101.28%	1'012'800.00	0.74	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	1'000	0	0	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.75	a)
CH0212184037	6.2541 % ALPHSW FLOAT PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.75	a)
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	1'250	0	0	1'250 CHF	101.95%	1'274'375.00	0.94	a)
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	1'000	0	0	1'000 CHF	100.00%	1'000'000.00	0.73	a)
CH0275776430	1.1250 % ISHZ 1 1/8 04/17/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0285509334	2.1250 % ALPHSW 2 1/8 06/30/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415953	0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN	0	1'070	0	1'070 CHF	99.68%	1'066'576.00	0.78	a)
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	0	2'000	500	1'500 CHF	94.75%	1'421'250.00	1.04	a)
CH0326371421	1.0000 % HIAGSW 1 07/04/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143170	0.0000 % PSPNSW 0 09/01/23	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587735	0.1800 % CMBNSW 0.18 10/05/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	225	0	225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	1'000	0	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.72	a)
CH0398633450	0.8750 % MOBNSW 0 7/8 10/02/23	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633724	3.5000 % HOLNSW 3 1/2 PERP	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677739	0.5500 % AMALEA 0.55 02/10/23	2'000	1'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	1'000	0	0	1'000 CHF	94.95%	949'500.00	0.70	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'500	0	0	1'500 CHF	99.76%	1'496'400.00	1.10	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	900	0	0	900 CHF	98.30%	884'700.00	0.65	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	1'000	0	0	1'000 CHF	88.50%	885'000.00	0.65	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'000	0	0	1'000 CHF	75.25%	752'500.00	0.55	a)
CH0419041519	0.0500 % IRENSW 0.05 10/09/23	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042566	2.6250 % VONTOB 2 5/8 PERP	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.45%	994'500.00	0.73	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNWX 0 3/4 10/12/28	1'000	0	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.71	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNWX 0 06/06/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	97.91%	1'468'650.00	1.08	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	0	1'500	0	1'500 CHF	92.20%	1'383'000.00	1.02	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'250	0	0	1'250 CHF	97.90%	1'223'750.00	0.90	a)
CH0475070238	1.8000 % KBLUZE 1.8 PERP	0	1'000	0	1'000 CHF	85.60%	856'000.00	0.63	a)
CH0481013784	2.3750 % BAERVX 2 3/8 PERP	0	1'000	0	1'000 CHF	87.95%	879'500.00	0.65	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 CHF	in % 7)	Kat.
CH0485261355	1.5000 % KBLUZE 1 1/2 PERP	500	0	0	500 CHF	79.05%	395'250.00	0.29	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	0	1'000	0	1'000 CHF	91.85%	918'500.00	0.67	a)
CH0521617305	1.5000 % HELNSW 1 1/2 PERP	1'000	0	0	1'000 CHF	96.55%	965'500.00	0.71	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'000	0	0	1'000 CHF	85.70%	857'000.00	0.63	a)
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	0	1'000	1'000	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	99.55%	995'500.00	0.73	a)
CH0536893602	1.0000 % STMNSW 1 10/03/23	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763522	0.7500 % COOPSW 0 3/4 05/05/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032943	1.0500 % GVAERO 1.05 05/26/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.60%	986'000.00	0.72	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	320	0	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.35%	943'500.00	0.69	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	700	800	0	1'500 CHF	91.55%	1'373'250.00	1.01	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	850	0	0	850 CHF	89.00%	756'500.00	0.56	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	93.50%	935'000.00	0.69	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	570	0	0	570 CHF	97.35%	554'895.00	0.41	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	0	1'000	0	1'000 CHF	92.35%	923'500.00	0.68	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	0	1'000	0	1'000 CHF	97.40%	974'000.00	0.72	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	1'000	0	0	1'000 CHF	93.80%	938'000.00	0.69	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000	0	0	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.66	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	1'000	0	0	1'000 CHF	90.31%	903'060.00	0.66	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	0	1'000	0	1'000 CHF	98.38%	983'800.00	0.72	a)
CH1167887285	0.0000 % ABBNVX 0 09/25/23	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	1'500	0	0	1'500 CHF	98.40%	1'476'000.00	1.08	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	650	0	0	650 CHF	104.75%	680'875.00	0.50	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	0	1'000	0	1'000 CHF	102.80%	1'028'000.00	0.76	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	875	0	875	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	1'000	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.75	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	1'000	0	0	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.75	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	0	1'000	0	1'000 CHF	100.95%	1'009'500.00	0.74	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	1'000	0	0	1'000 CHF	103.00%	1'030'000.00	0.76	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.75%	1'027'500.00	0.75	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	2'000	1'000	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.74	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	600	0	600 CHF	103.15%	618'900.00	0.45	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	1'000	0	1'000 CHF	101.20%	1'012'000.00	0.74	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	500	0	500 CHF	101.70%	508'500.00	0.37	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	1'000	0	1'000 CHF	101.24%	1'012'400.00	0.74	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	0	1'000	0	1'000 CHF	106.70%	1'067'000.00	0.78	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.50%	1'537'500.00	1.13	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	1'000	0	1'000 CHF	101.40%	1'014'000.00	0.74	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	700	0	700 CHF	104.65%	732'550.00	0.54	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	1'150	0	1'150 CHF	105.05%	1'208'075.00	0.89	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	750	0	750 CHF	104.85%	786'375.00	0.58	a)
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	655	0	655 CHF	102.70%	672'685.00	0.49	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	1'000	0	1'000 CHF	100.70%	1'007'030.00	0.74	a)
CH							57'342'146.00	42.12	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	0	500	0	500 CHF	94.80%	474'000.00	0.35	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.10%	951'000.00	0.70	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.70%	1'007'000.00	0.74	a)
CL							2'432'000.00	1.79	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.35%	893'500.00	0.66	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	94.40%	755'200.00	0.55	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 CHF	in % 7)	Kat.
CH113555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.40%	914'000.00	0.67	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	103.00%	1'030'000.00	0.76	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	112.40%	1'124'000.00	0.83	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	600	1'000	0	1'600 CHF	103.15%	1'650'400.00	1.21	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.74	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	1'000	500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	105.55%	1'055'500.00	0.78	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	1'000	0	1'000 CHF	105.50%	1'055'000.00	0.77	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	930	0	930 CHF	104.25%	969'525.00	0.71	a)
DE							10'454'625.00	7.68	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000	0	0	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.72	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.10%	1'041'000.00	0.76	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	104.30%	1'564'500.00	1.15	a)
ES							3'584'000.00	2.63	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	99.75%	2'294'250.00	1.69	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	94.80%	948'000.00	0.70	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	93.30%	1'866'000.00	1.37	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	93.40%	934'000.00	0.69	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.95%	929'500.00	0.68	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	200	0	200 CHF	93.45%	186'900.00	0.14	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.95%	1'039'500.00	0.76	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.55%	1'025'500.00	0.75	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.75	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.75	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.35%	1'013'500.00	0.74	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.90%	1'039'000.00	0.76	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.40%	1'034'000.00	0.76	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.74	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.75	a)
FR							16'395'650.00	12.04	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.09%	990'900.00	0.73	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	600	1'000	0	1'600 CHF	90.00%	1'440'000.00	1.06	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.80%	928'000.00	0.68	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	650	0	0	650 CHF	98.31%	639'015.00	0.47	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.73	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.75	a)
GB							6'014'415.00	4.42	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	1'000	2'400	0	3'400 CHF	98.80%	3'359'200.00	2.47	a)
IE							3'359'200.00	2.47	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.54%	1'990'800.00	1.46	a)
JE							1'990'800.00	1.46	
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	0	2'000	0	2'000 CHF	100.75%	2'015'000.00	1.48	a)
KR							2'015'000.00	1.48	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	1'000	0	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.75	a)
LI							1'020'500.00	0.75	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LU							0.00	0.00	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	900	0	0	900 CHF	97.65%	878'850.00	0.65	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 CHF	in % 7)	Kat.
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.72	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	1'250	250	0	1'500 CHF	91.75%	1'376'250.00	1.01	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	97.30%	973'000.00	0.71	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.75	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	545	545	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.30%	1'519'500.00	1.12	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	870	0	870 CHF	101.67%	884'502.90	0.65	a)
NL							7'633'102.90	5.61	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	92.30%	923'000.00	0.68	a)
NZ							923'000.00	0.68	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.75%	967'500.00	0.71	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.40%	944'000.00	0.69	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.69	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.75%	917'500.00	0.67	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	103.70%	1'037'000.00	0.76	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	500	0	500 CHF	104.00%	520'000.00	0.38	a)
US							5'327'000.00	3.91	
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	750	0	0	750 CHF	99.72%	747'900.00	0.55	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.45%	1'989'000.00	1.46	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	100.30%	1'003'000.00	0.74	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	101.90%	1'019'000.00	0.75	a)
XS							4'758'900.00	3.50	

Derivative Finanzinstrumente

621'581.83 0.46

Kreditderivate

338'039.20 0.25

12/27	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/27	5'100	0	5'100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	-1'000	1'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.39 12/27	-900	900	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.39 12/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/27	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27	2'000	0	0	2'000 EUR	9.64	179'735.55	0.13	a)
06/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 06/28	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/28	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 06/28	0	9'200	9'200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/28	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.40 06/28	0	10'000	10'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/28	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.40 06/28	0	1'600	1'600	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/28	5.0000 % MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28	0	0	1'700	-1'700 EUR	7.60	-120'438.84	-0.09	a)
12/28	1.0000 % MARKIT ITRX EUROPE 12/28	0	9'500	0	9'500 EUR	1.90	168'287.00	0.12	a)
12/28	1.0000 % MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28	0	9'900	0	9'900 USD	2.05	173'723.20	0.13	a)
12/28	5.0000 % MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28	0	0	1'200	-1'200 USD	6.15	-63'267.71	-0.05	a)

Swaps

283'542.63 0.21

12/32	IRS FIX LEG 1.8775% P.A. CHF	3'000	0	0	3'000 CHF	105.98%	3'179'339.96	2.34	b)
12/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	-3'000	0	0	-3'000 CHF	100.00	-3'000'000.00	-2.20	b)
10/35	IRS FIX LEG 1.74% P.A. CHF	0	2'000	0	2'000 CHF	105.21%	2'104'202.67	1.55	b)
10/35	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	0	0	2'000	-2'000 CHF	100.00	-2'000'000.00	-1.47	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'851'742.46	1.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	132'525'838.90	97.33
Derivative Finanzinstrumente	621'581.83	0.46
Sonstige Vermögenswerte	1'155'377.29	0.85
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	136'154'540.48	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-66'792.60	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	136'087'747.88	

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);	132'863'878.10	97.58
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	283'542.63	0.21
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	29'629'055.00	21.76
------------------------------	----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				29'629'055.00	21.76
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.72
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'000 CHF	98.10%	981'000.00	0.72
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	500 CHF	94.95%	474'750.00	0.35
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	500 CHF	99.76%	498'800.00	0.37
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'000 CHF	75.25%	752'500.00	0.55
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	750 CHF	99.72%	747'900.00	0.55
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'250 CHF	97.90%	1'223'750.00	0.90
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	500 CHF	85.70%	428'500.00	0.31
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	700 CHF	87.95%	615'650.00	0.45
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	600 CHF	93.30%	559'800.00	0.41
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	500 CHF	94.40%	472'000.00	0.35
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.69
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	450 CHF	93.50%	420'750.00	0.31
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	570 CHF	97.35%	554'895.00	0.41
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.69
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	500 CHF	92.95%	464'750.00	0.34
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'000 CHF	92.30%	923'000.00	0.68
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'000 CHF	90.25%	902'500.00	0.66
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	1'000 CHF	90.31%	903'060.00	0.66
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	650 CHF	104.75%	680'875.00	0.50
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	900 CHF	99.80%	898'200.00	0.66
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	1'000 CHF	102.80%	1'028'000.00	0.76
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	1'000 CHF	103.95%	1'039'500.00	0.76
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.75
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	1'000 CHF	103.00%	1'030'000.00	0.76
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.75
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	500 CHF	100.75%	503'750.00	0.37
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	500 CHF	101.90%	509'500.00	0.37
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	1'000 CHF	103.15%	1'031'500.00	0.76
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	650 CHF	100.75%	654'875.00	0.48
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.75
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	1'000 CHF	102.65%	1'026'500.00	0.75
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	500 CHF	103.90%	519'500.00	0.38
CH1276269763	2.9325 % SANSFC 2.9325 07/04/28 EMTN	1'500 CHF	104.30%	1'564'500.00	1.15
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	500 CHF	101.24%	506'200.00	0.37
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	500 CHF	101.40%	507'000.00	0.37
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	1'150 CHF	105.05%	1'208'075.00	0.89
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	70 CHF	104.25%	72'975.00	0.05

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.93183793
USD	1 = CHF	0.85785000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	11'221'581.25	35.610
Bond	CHF	20'242'177.61	64.236
Equity	CHF	48'677.04	0.154
Total	CHF	31'512'435.90	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	27'105'938.31	19.918
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	20'877'202.21	15.341
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

6 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
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT 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	29'629'055.00
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: 01.02.2023 - 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
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
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000

Periode: 03.02.2023 - 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
NT CHF	-	-	-	-	4.000

Periode: 01.03.2023 - 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
DT CHF	0.500	0.700	0.400	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 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
AA CHF	Nein	CHF	0.35000	0.12250	0.22750
BA CHF	Nein	CHF	0.70000	0.24500	0.45500

12 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
CT CHF	Nein	CHF	0.76100	0.26635	0.49465
DT CHF	Nein	CHF	0.81939	0.28678	0.53261
GT CHF	Nein	CHF	0.97231	0.34030	0.63201
NT CHF	Nein	CHF	1.360	0.476	0.884

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.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

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 zurück-genommen 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 Marktrendite 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 Anteils-klasse 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, marktconforme 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-Net-toinventarwertes, 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. 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 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 Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Corporate CHF

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts

der Art "Effektenfonds"

(nachfolgend der "Anlagefonds")

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

Die Anlagepolitik des Anlagefonds soll in § 8 Ziff. 2 Bst. aa des Fondsvertrages präzisiert werden.

In der erwähnten Bestimmung werden bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

In der angepassten Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. aa des Fondsvertrages ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (auf Schweizer Franken lautende Obligationen, Notes, Bail-in Bonds sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von nicht staatlichen in- und ausländischen Emittenten zu den zulässigen Anlagen gehören.

* * *

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

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

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

Zürich, 14. April 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich