

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art «Effektenfonds»

Jahresbericht per 31. Januar 2021

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	22
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung.....	22
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	22
Pauschale Verwaltungskommission	23
Benchmark.....	23
TER.....	23
Ausschüttung des Nettoertrags 2020 / 2021	23
Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021.....	24
Erklärung der Fussnoten	24
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	25
Pflichtpublikationen.....	27
Bericht der Prüfgesellschaft.....	30

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 28.05.2021

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

Regina Kleeb, Mitglied
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer

Andreas Hogg
stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE

Übersicht	von bis	01.02.2020 31.01.2021	01.02.2019 31.01.2020	01.02.2018 31.01.2019	01.02.2017 31.01.2018
Konsolidiert		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		902'583'938.30	939'625'725.52	918'733'179.72	1'055'677'750.57
Klasse AA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		182'335'646.47	216'469'674.66	258'687'247.43	333'112'348.60
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'407'440.233	2'759'105.170	3'387'110.152	4'506'091.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		75.74	78.46	76.37	73.92
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		75.84	78.42	76.33	73.89
Ausschüttung je Anteil		0.60	1.00	1.00	1.00
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.96 %	0.96 %	0.97 %	0.96 %
Klasse BA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		810'037.39	862'660.17	581'998.19	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'022.298	8'256.233	5'728.233	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		100.97	104.49	101.60	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		101.10	104.43	101.54	
Ausschüttung je Anteil		1.20	1.60	1.60	
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.59 %	0.59 %	0.60 %	
Klasse CT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'156'655.43	3'844'224.98	3'627'017.25	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		39'566.894	35'746.444	35'191.651	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		105.05	107.54	103.06	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		105.19	107.49	103.00	
Thesaurierung je Anteil		1.34	1.73	0.55	
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.51 %	
Klasse DA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'938'776.15	29'110'161.56	30'371'145.25	29'400'829.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		240'212.203	323'073.100	346'234.516	346'224.796
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.17	90.10	87.72	84.92
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		87.28	90.06	87.67	84.88
Ausschüttung je Anteil		1.20	1.40	1.60	1.60
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.46 %	0.46 %	0.47 %	0.46 %
Klasse GT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		58'761'597.31	59'326'766.95	53'485'801.68	50'304'433.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		516'627.618	509'888.889	477'831.835	470'219.400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		113.74	116.35	111.93	106.98
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		113.89	116.29	111.87	106.93
Thesaurierung je Anteil		1.58	2.00	2.21	2.00
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.39 %	0.39 %	0.38 %	0.36 %
Klasse NT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		635'581'225.55	630'012'237.20	571'979'969.92	642'860'139.54
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'484'630.170	5'327'608.971	5'040'859.971	5'942'457.385
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		115.88	118.25	113.47	108.18
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		116.03	118.20	113.40	108.13
Thesaurierung je Anteil		2.05	2.47	2.64	2.41
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.01 %	0.01 %	0.02 %	0.01 %

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

Performance	YTD / 31.01.2021	2020	2019	2018
Klasse AA CHF	-0.33 %	-0.73 %	5.35 %	-1.07 %
Klasse BA CHF (Lancierung 06.08.2018)	-0.31 %	-0.37 %	5.74 %	-0.71 %
Klasse CT CHF (Lancierung 23.10.2018)	-0.29 %	-0.28 %	5.84 %	0.71 %
Klasse DA CHF	-0.41 %	-0.25 %	5.88 %	-0.62 %
Klasse GT CHF	-0.41 %	-0.17 %	5.95 %	-0.54 %
Klasse NT CHF	-0.39 %	0.21 %	6.36 %	-0.18 %

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)

	31.01.2021	31.01.2020
Bankguthaben auf Sicht	12'280'133.22	26'085'791.97
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	817'827'357.52	858'980'138.71
Strukturierte Produkte	22'823'636.36	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	46'076'205.06	49'705'440.82
Sonstige Vermögenswerte	3'751'748.59	5'076'269.78
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	902'759'080.75	939'847'641.28
Andere Verbindlichkeiten	-175'142.45	-221'915.76
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	902'583'938.30	939'625'725.52

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF

	von	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'759'105.170	3'387'110.152
Ausgegebene Anteile		4'704.118	17'127.018
Zurückgenommene Anteile		-356'369.055	-645'132.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'407'440.233	2'759'105.170

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse BA CHF

	von	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'256.233	5'728.233
Ausgegebene Anteile		-	3'770.000
Zurückgenommene Anteile		-233.935	-1'242.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'022.298	8'256.233

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse CT CHF

	von	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		35'746.444	35'191.651
Ausgegebene Anteile		6'193.172	6'069.967
Zurückgenommene Anteile		-2'372.722	-5'515.174
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		39'566.894	35'746.444

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DA CHF

	von	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		323'073.100	346'234.516
Ausgegebene Anteile		10'700.000	710.000
Zurückgenommene Anteile		-93'560.897	-23'871.416
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		240'212.203	323'073.100

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse GT CHF

	von	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		509'888.889	477'831.835
Ausgegebene Anteile		60'526.406	69'274.054
Zurückgenommene Anteile		-53'787.677	-37'217.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		516'627.618	509'888.889

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.02.2020	01.02.2019
		bis	31.01.2021	31.01.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			5'327'608.971	5'040'859.971
Ausgegebene Anteile			378'487.000	441'177.000
Zurückgenommene Anteile			-221'465.801	-154'428.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			5'484'630.170	5'327'608.971

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.02.2020	01.02.2019
		bis	31.01.2021	31.01.2020
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			939'625'725.52	918'733'179.72
Ausbezahlte Ausschüttung			-3'012'868.53	-3'721'049.35
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-4'828'689.26	-5'081'834.88
Saldo aus dem Anteilverkehr			-16'203'985.69	-14'011'855.60
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			-12'996'243.74	43'707'285.21
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			902'583'938.30	939'625'725.52

Erfolgsrechnung	(konsolidiert)	von	01.02.2020	01.02.2019
		bis	31.01.2021	31.01.2020
Ertrag				
Erträge der Bankguthaben auf Sicht			8'273.75	50'519.99
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-55'387.40	-17'441.73
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			14'554'454.20	18'240'405.06
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen			1'128'287.93	1'363'195.51
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			779'613.78	956'202.99
Total Ertrag			16'415'242.26	20'592'881.82
Aufwand				
Passivzinsen			-17'385.14	-69'230.26
Reglementarische Vergütungen			-2'218'723.69	-2'638'613.09
Sonstige Aufwendungen			1'689.80	7'983.99
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-264'082.54	-703'706.35
Total Aufwand			-2'498'501.57	-3'403'565.71
Nettoertrag / Verlust			13'916'740.69	17'189'316.11
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			3'318'784.62	21'825'152.42
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)			134'825.79	59'037.57
Realisierter Erfolg			17'370'351.10	39'073'506.10
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-30'366'594.84	4'633'779.53
Gesamterfolg			-12'996'243.74	43'707'285.63

Verwendung des Erfolges		31.01.2021	31.01.2020
Klasse AA CHF			
Nettoertrag		1'498'020.98	2'431'516.32
Vortrag des Vorjahres		72'243.61	399'832.46
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		1'570'264.59	2'831'348.78
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		1'444'464.14	2'759'105.17
Vortrag auf neue Rechnung		125'800.45	72'243.61
Total		1'570'264.59	2'831'348.78
Klasse BA CHF			
Nettoertrag		9'696.33	13'318.09
Vortrag des Vorjahres		472.08	363.96
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		10'168.41	13'682.05
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		9'626.76	13'209.97
Vortrag auf neue Rechnung		541.65	472.08
Total		10'168.41	13'682.05
Klasse CT CHF			
Nettoertrag		53'408.37	61'794.20
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		53'408.37	61'794.20
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		18'692.93	21'627.97
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		34'715.44	40'166.23
Total		53'408.37	61'794.20
Klasse DA CHF			
Nettoertrag		263'261.50	479'697.95
Vortrag des Vorjahres		58'470.00	31'074.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		321'731.50	510'772.34
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		288'254.64	452'302.34
Vortrag auf neue Rechnung		33'476.86	58'470.00
Total		321'731.50	510'772.34
Klasse GT CHF			
Nettoertrag		819'587.82	1'019'401.17
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		819'587.82	1'019'401.17
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		286'855.74	356'790.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		532'732.08	662'610.76
Total		819'587.82	1'019'401.17
Klasse NT CHF			
Nettoertrag		11'272'765.69	13'183'588.38
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		11'272'765.69	13'183'588.38
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		3'945'467.99	4'614'255.93
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		7'327'297.70	8'569'332.45
Total		11'272'765.69	13'183'588.38

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind								863'903'562.58	95.70	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								817'827'357.52	90.59	
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	3'000	0	3'000	AUD	98.08 %	2'008'219.79	0.22	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	2'000	0	500	1'500	AUD	136.72 %	1'399'744.04	0.16	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	0	600	0	600	AUD	118.75 %	486'313.74	0.05	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	3'000	0	700	2'300	AUD	112.95 %	1'773'088.29	0.20	a)
AU3CB0246478	3.2500 % SGT OPT 3 1/4 08/23/22 MTN	1'300	0	1'300	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3CB0247393	3.7500 % SGSPAA 3 3/4 09/27/24 MTN	400	0	0	400	AUD	111.17 %	303'519.84	0.03	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	2'000	0	0	2'000	AUD	120.99 %	1'651'664.80	0.18	a)
AU3CB0250355	4.1500 % QNBK 4.15 02/01/23 MTN	1'800	0	1'800	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	400	0	0	400	AUD	105.15 %	287'089.60	0.03	a)
AU3CB0266013	2.4000 % VW 2.4 08/28/24 MTN	600	0	0	600	AUD	104.15 %	426'514.55	0.05	a)
AU3CB0273357	0.5150 % AUSTC 0.515 01/29/24 MTN	0	1'900	1'200	700	AUD	100.73 %	481'274.51	0.05	a)
AU3CB0274280	5.2500 % QANAU 5 1/4 09/09/30 MTN	0	1'400	0	1'400	AUD	111.79 %	1'068'205.71	0.12	a)
AU3SG0001837	3.0000 % SAFA 3 05/24/28 28	3'000	0	0	3'000	AUD	114.75 %	2'349'560.85	0.26	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	0	1'700	0	1'700	AUD	100.29 %	1'163'738.88	0.13	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	1'800	0	1'800	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	1'000	0	1'000	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AUD								13'398'934.60	1.48	
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	11'000	0	2'000	9'000	CAD	135.51 %	8'492'756.86	0.94	a)
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	3'000	0	3'000	0	CAD	0.00 %	0.00	0.00	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	2'750	0	1'000	1'750	CAD	107.50 %	1'310'103.04	0.15	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	1'500	0	0	1'500	CAD	129.93 %	1'357'234.53	0.15	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	4'500	0	4'500	CAD	96.57 %	3'026'318.28	0.34	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	2'000	0	0	2'000	CAD	148.32 %	2'065'805.16	0.23	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	2'000	0	0	2'000	CAD	106.31 %	1'480'658.74	0.16	a)
CA459058HS51	1.9000 % IBRD 1.9 01/16/25 GDIF	4'000	0	2'000	2'000	CAD	105.34 %	1'467'134.90	0.16	a)
US052591AT11	5.0000 % AUST 5 12/20/24 EMTN	3'335	0	0	3'335	CAD	117.57 %	2'730'390.39	0.30	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	0	4'000	0	4'000	CAD	100.28 %	2'793'265.01	0.31	a)
CAD								24'723'666.91	2.74	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	3'000	0	0	3'000	CHF	125.21 %	3'756'300.00	0.42	a)
CHF								3'756'300.00	0.42	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	0	29'000	0	29'000	CNY	100.07 %	3'995'781.25	0.44	a)
CNY								3'995'781.25	0.44	
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	4'500	0	0	4'500	DKK	129.15 %	844'503.88	0.09	a)
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	3'000	0	0	3'000	DKK	187.13 %	815'775.70	0.09	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'000	0	0	8'000	DKK	111.15 %	1'292'114.22	0.14	a)
DKK								2'952'393.80	0.33	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
AT0000A2GH08	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/13/27 EMTN	0	1'300	600	700	EUR	105.33 %	796'846.47	0.09	a)
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	0	800	0	800	EUR	104.33 %	902'087.32	0.10	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	0	6'000	6'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	0	2'800	0	2'800	EUR	103.16 %	3'121'687.48	0.35	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	4'000	0	4'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	0	3'800	3'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	0	3'000	0	3'000	EUR	102.46 %	3'322'130.91	0.37	a)
BE0002709906	1.0500 % WALLOO 1.05 06/22/40 EMTN	0	4'000	4'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0974365976	0.3750 % KBCBB 0 3/8 06/16/27 EMTN	0	1'600	0	1'600	EUR	101.30 %	1'751'674.73	0.19	a)
BE6321076711	1.6250 % LONNVX 1 5/8 04/21/27	0	300	300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	0	1'600	0	1'600	EUR	100.71 %	1'741'576.10	0.19	a)
CH0483180946	1.0000 % CS 1 06/24/27 EMTN	2'200	0	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	0	3'200	0	3'200	EUR	99.73 %	3'449'154.87	0.38	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	0	4'200	0	4'200	EUR	105.75 %	4'800'189.14	0.53	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	0	7'000	0	7'000	EUR	103.64 %	7'840'986.80	0.87	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	0	1'400	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	3'500	1'500	2'000	EUR	104.96 %	2'268'749.66	0.25	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A254PM6	0.0000 % KFW 0 02/18/25 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	0	1'700	0	1'700	EUR	108.70 %	1'997'171.51	0.22	a)
DE000A289F29	0.0000 % KFW 0 12/15/27 EMTN	0	5'000	5'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A289XH6	1.6250 % DAIGR 1 5/8 08/22/23 EMTN	0	1'500	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A28RSR6	0.5000 % ALVGR 0 1/2 01/14/31 EMTN	2'200	0	0	2'200	EUR	103.36 %	2'457'604.98	0.27	a)
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	2'700	0	700	2'000	EUR	113.62 %	2'455'962.20	0.27	a)
DE000A2RYD91	1.3750 % DAIGR 1 3/8 06/26/26 EMTN	2'150	0	2'150	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A2SBDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	1'000	0	0	1'000	EUR	104.38 %	1'128'117.12	0.12	a)
DE000A2TR8W8	0.3750 % NIESA 0 3/8 05/14/29	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A2TSTU4	0.0000 % KFW 0 09/30/26 EMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A2YB7B5	2.8750 % SHAEFF 2 7/8 03/26/27 EMTN	700	0	700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A3H2ZF6	0.0000 % KFW 0 01/10/31 EMTN	0	1'900	0	1'900	EUR	103.39 %	2'123'031.47	0.24	a)
DE000CZ45V82	0.3750 % CMZB 0 3/8 09/01/27 EMTN	0	4'100	4'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000LB13HZ5	2.2000 % LBBW 2.2 05/09/29 EMTN	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000LB2CRG6	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/18/27 EMTN	0	7'000	7'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000NRW0MA1	0.2000 % NRW 0.2 04/09/30	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000NRW0ML8	0.0000 % NRW 0 10/12/35 15YR	0	5'150	5'150	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000NWB0AL1	0.0000 % NRWK 0 02/03/31 EMTN	0	3'000	0	3'000	EUR	102.02 %	3'307'897.05	0.37	a)
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	8'000	0	3'000	5'000	EUR	108.74 %	5'876'222.98	0.65	a)
ES0000012B62	0.3500 % SPGB 0.35 07/30/23	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	4'120	1'400	4'520	1'000	EUR	104.16 %	1'125'782.64	0.12	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	0	2'700	2'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	4'500	1'500	3'000	EUR	109.20 %	3'540'469.89	0.39	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	0	2'800	0	2'800	EUR	101.59 %	3'074'327.74	0.34	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	0	3'650	0	3'650	EUR	99.46 %	3'923'383.40	0.43	a)
ES0413900574	0.1250 % SANTAN 0 1/8 06/04/30	3'000	1'500	1'500	3'000	EUR	103.24 %	3'347'259.03	0.37	a)
ES0413900608	0.1000 % SANTAN 0.1 02/27/32	0	1'300	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A1G0EJ9	0.0000 % EFSF 0 10/15/25	0	1'700	1'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A1Z99L8	0.0100 % ESM 0.01 03/04/30	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A285VM2	0.0000 % EU 0 07/04/35 EMTN	0	1'520	1'520	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A287074	0.0000 % EU 0 06/02/28 EMTN	0	1'700	0	1'700	EUR	103.68 %	1'904'901.09	0.21	a)
FR0012173862	2.1250 % RIFP 2 1/8 09/27/24	1'600	0	0	1'600	EUR	107.81 %	1'864'317.84	0.21	a)
FR0013299435	1.0000 % RENAUL 1 11/28/25 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013372299	1.1250 % SOGRPR 1 1/8 10/22/28 EMTN	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013397452	1.6250 % DGFP 1 5/8 01/18/29 EMTN	1'900	0	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013422383	1.7000 % SOGRPR 1.7 05/25/50 EMTN	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013424868	0.6250 % VIVFP 0 5/8 06/11/25 EMTN	2'000	0	0	2'000	EUR	102.88 %	2'223'789.25	0.25	a)
FR0013424876	1.1250 % VIVFP 1 1/8 12/11/28 EMTN	1'800	1'200	0	3'000	EUR	106.78 %	3'462'264.72	0.38	a)
FR0013431137	0.2500 % AGFRNC 0 1/4 06/29/29 EMTN	1'900	0	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013431244	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 PERP	1'300	0	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	2'400	0	2'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013444304	0.1000 % HSBC 0.1 09/03/27 EMTN	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013444676	0.0000 % ORAFP 0 09/04/26 EMTN	2'000	0	0	2'000	EUR	100.17 %	2'165'275.88	0.24	a)
FR0013457058	0.5000 % ALSFR 0 1/2 10/30/34 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013464815	0.7500 % AKEFP 0 3/4 12/03/29	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013479276	0.7500 % SOCGEN 0 3/4 01/25/27	2'500	0	500	2'000	EUR	101.98 %	2'204'378.46	0.24	a)
FR0013480514	0.2500 % CRH 0 1/4 02/07/35	1'500	700	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	2'850	0	2'850	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013483526	0.0000 % AGFRNC 0 03/25/25 EMTN	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013508686	0.6250 % FRPTT 0 5/8 10/21/26 EMTN	0	800	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013509726	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 04/28/25	0	3'000	2'000	1'000	EUR	102.91 %	1'112'208.05	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013510179	2.8750 % AUCHAN 2 7/8 01/29/26 EMTN	0	1'400	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013511599	1.7000 % SOGRPR 1.7 05/25/50 APR	0	5'000	5'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013516077	0.5000 % EFFF 0 1/2 06/05/28 EMTN	0	1'700	0	1'700	EUR	102.95 %	1'891'525.37	0.21	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	0	2'000	0	2'000	EUR	102.79 %	2'221'865.47	0.25	a)
FR0013518099	1.0000 % SNCF 1 05/25/40	0	4'500	4'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013522133	1.0000 % ADPPF 1 01/05/29	0	1'500	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013532280	0.5000 % BNP 0 1/2 09/01/28	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013534559	0.0000 % CADES 0 11/25/30	0	3'000	2'000	1'000	EUR	101.38 %	1'095'715.37	0.12	a)
FR0013534674	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN	0	2'100	2'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR00140005B8	0.0000 % SOGRPR 0 11/25/30 EMTN	0	2'800	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	0	1'800	0	1'800	EUR	100.78 %	1'960'653.96	0.22	a)
FR00140005R4	0.7000 % SOGRPR 0.7 10/15/60 EMTN	0	1'400	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014000774	0.7500 % LAMON 0 3/4 04/20/26	0	1'000	0	1'000	EUR	100.72 %	1'088'549.80	0.12	a)
FR0014000C08	0.8750 % SNCF 0 7/8 02/28/51	0	2'600	2'600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014000L31	0.0000 % UNEDIC 0 11/19/30 EMTN	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014000MX1	0.0000 % SFILFR 0 11/23/28 EMTN	0	1'500	0	1'500	EUR	101.78 %	1'649'992.88	0.18	a)
FR0014000OZ2	1.0000 % SOCGEN 1 11/24/30 EMTN	0	1'300	300	1'000	EUR	100.00 %	1'080'800.62	0.12	a)
FR0014001S17	0.0000 % CADES 0 05/25/31 EMTN	0	1'500	0	1'500	EUR	101.18 %	1'640'363.14	0.18	a)
HK0000659794	0.0000 % CHINA 0 11/25/25	0	3'000	0	3'000	EUR	100.83 %	3'269'248.72	0.36	a)
IE00BKFVC345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	3'500	0	3'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	0	2'500	0	2'500	EUR	102.12 %	2'759'120.71	0.31	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25	9'000	0	9'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005387052	0.4000 % BTPS 0.4 05/15/30 CPI	5'000	7'100	12'100	0	EUR	107.81 %	0.00	0.00	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27	5'500	0	2'500	3'000	EUR	103.93 %	3'369'740.42	0.37	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	2'250	0	2'250	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30	0	2'500	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30	0	1'100	1'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005415416	0.6500 % BTPS 0.65 05/15/26 CPI	0	5'000	0	5'000	EUR	106.51 %	5'755'558.82	0.64	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24	0	2'400	0	2'400	EUR	100.62 %	2'610'062.09	0.29	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51	0	500	0	500	EUR	104.26 %	563'399.07	0.06	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37	0	2'700	0	2'700	EUR	98.35 %	2'869'867.05	0.32	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28	0	2'800	0	2'800	EUR	99.35 %	3'006'420.24	0.33	a)
LU2076841712	0.0000 % LGB 0 11/13/26	350	0	350	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
LU2162831981	0.0000 % LGB 0 04/28/30	0	550	550	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
LU2228213398	0.0000 % LGB 0 09/14/32	0	1'750	1'750	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	0	2'200	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	0	2'600	2'600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
PTOTELOE0028	0.4750 % PGB 0.475 10/18/30	3'500	0	3'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	0	5'300	1'300	4'000	EUR	107.18 %	4'633'558.96	0.51	a)
SI0002104121	0.6875 % SLOREP 0.6875 03/03/81	0	2'500	1'500	1'000	EUR	97.28 %	1'051'403.43	0.12	a)
XS0222383027	4.0000 % GSK 4 06/16/25 EMTN	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS0856014583	2.3750 % BATSLN 2 3/8 01/19/23 EMTN	850	0	850	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS0903433513	2.5000 % T 2 1/2 03/15/23	850	0	850	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS0990109240	3.0000 % IBESM 3 01/31/22 EMTN	600	0	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1072796870	2.5000 % SEB 2 1/2 05/28/26 GMTN	1'300	0	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1107727007	2.1250 % C 2 1/8 09/10/26 EMTN	1'650	0	350	1'300	EUR	110.73 %	1'555'700.31	0.17	a)
XS1245292807	4.3750 % SLHNXV 4 3/8 PERP	1'900	0	900	1'000	EUR	111.80 %	1'208'256.88	0.13	a)
XS1418630023	1.7500 % NDAQ 1 3/4 05/19/23	1'100	0	1'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1419646317	1.5000 % BNP 1 1/2 05/25/28 EMTN	3'300	0	1'300	2'000	EUR	110.48 %	2'388'089.28	0.26	a)
XS1493333717	0.8750 % SWEMAT 0 7/8 09/23/24 GMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1557268221	1.3750 % SANTAN 1 3/8 02/09/22	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1565699763	1.1250 % RYRID 1 1/8 08/15/23 EMTN	500	0	500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1671760384	0.5000 % PHIANA 0 1/2 09/06/23	2'200	0	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1681050610	1.5000 % LLOYDS 1 1/2 09/12/27 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1681520786	1.7500 % TCLAU 1 3/4 03/29/28 EMTN	1'200	0	0	1'200	EUR	110.22 %	1'429'520.44	0.16	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1748456974	1.1250 % BNP 1 1/8 06/11/26 EMTN	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1751004232	1.1250 % SANTAN 1 1/8 01/17/25 EMTN	2'400	0	2'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1811198701	1.7500 % SYDAU 1 3/4 04/26/28 EMTN	1'800	0	1'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1823518730	1.0000 % WURTH 1 05/26/25 EMTN	1'700	0	500	1'200	EUR	104.97 %	1'361'340.58	0.15	a)
XS1843436228	1.5000 % FIS 1 1/2 05/21/27	1'200	0	0	1'200	EUR	107.64 %	1'396'020.62	0.15	a)
XS1843459782	1.8000 % IFF 1.8 09/25/26	1'200	0	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1872038218	1.3750 % BKIR 1 3/8 08/29/23 EMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1877595444	1.2500 % HEIANA 1 1/4 03/17/27 EMTN	2'475	0	2'475	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	1'200	0	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1896660989	1.0000 % DGELN 1 04/22/25 EMTN	600	0	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1933820372	2.1250 % INTNED 2 1/8 01/10/26 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1935139995	0.8750 % ABNAV 0 7/8 01/15/24 EMTN	2'200	0	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1954087695	2.5750 % BBVASM 2.575 02/22/29 GMTN	1'100	0	0	1'100	EUR	105.42 %	1'253'340.50	0.14	a)
XS1955024986	1.2500 % KO 1 1/4 03/08/31	750	0	750	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	2'000	0	0	2'000	EUR	106.87 %	2'310'035.42	0.26	a)
XS1960678412	1.6250 % MDT 1 5/8 03/07/31	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1974787480	1.7500 % TOTAL 1 3/4 PERP EMTN	400	0	400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2010030752	1.3750 % MAGYAR 1 3/8 06/24/25	0	1'500	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2010032881	0.8750 % NDAQ 0 7/8 02/13/30	0	950	950	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	2'700	0	700	2'000	EUR	115.57 %	2'498'069.35	0.28	a)
XS2017471553	1.2500 % UCGIM 1 1/4 06/25/25 EMTN	1'700	0	1'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2018637327	1.1250 % HEIGR 1 1/8 12/01/27 EMTN	1'250	0	0	1'250	EUR	105.39 %	1'423'750.71	0.16	a)
XS2020608548	0.8750 % HERIM 0 7/8 07/05/27 EMTN	600	0	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2022425024	0.7500 % RESFER 0 3/4 05/25/36 EMTN	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2024602240	0.1000 % ASFING 0.1 07/09/29	1'700	0	1'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2025468542	0.0400 % CM 0.04 07/09/27 EMTN	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2027596530	2.1240 % ROMANI 2.124 07/16/31 REGS	1'900	0	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2027957815	1.1250 % BACRED 1 1/8 07/15/25 EMTN	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2043678841	0.1250 % GS 0 1/8 08/19/24 EMTN	2'500	0	500	2'000	EUR	100.27 %	2'167'480.67	0.24	a)
XS2046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	2'300	0	2'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	2'000	0	500	1'500	EUR	101.43 %	1'644'351.21	0.18	a)
XS2049616621	0.1250 % SIEGR 0 1/8 09/05/29	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	1'550	0	0	1'550	EUR	101.22 %	1'695'628.23	0.19	a)
XS2055104785	0.5000 % ASBBNK 0 1/2 09/24/29 EMTN	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2056374353	0.8750 % MDLZ 0 7/8 10/01/31 REGS	2'000	0	0	2'000	EUR	105.62 %	2'283'080.79	0.25	a)
XS2057070182	1.5000 % CKHGTH 1 1/2 10/17/31	2'500	0	500	2'000	EUR	106.23 %	2'296'114.99	0.25	a)
XS2058729653	0.3750 % BBVASM 0 3/8 10/02/24 EMTN	4'000	0	4'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	1'900	500	0	2'400	EUR	104.29 %	2'705'198.48	0.30	a)
XS2075185228	0.9000 % HOG 0.9 11/19/24	800	0	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2076155105	0.3750 % ABT 0 3/8 11/19/27	1'550	0	550	1'000	EUR	102.19 %	1'104'426.44	0.12	a)
XS2081543204	0.6250 % CAF 0 5/8 11/20/26 EMTN	2'100	0	2'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2081605912	0.0500 % BNG 0.05 11/20/29 EMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2083146964	1.1250 % ALB 1 1/8 11/25/25	1'900	0	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2084418339	0.8750 % CEZCP 0 7/8 12/02/26 EMTN	650	0	650	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2084497705	0.6250 % FMEGR 0 5/8 11/30/26 EMTN	1'250	0	0	1'250	EUR	102.58 %	1'385'815.36	0.15	a)
XS2089226026	1.7500 % DT 1 3/4 12/09/49 EMTN	3'250	0	1'250	2'000	EUR	112.31 %	2'427'624.17	0.27	a)
XS2089368596	0.7500 % ISPIM 0 3/4 12/04/24 EMTN	1'400	0	0	1'400	EUR	102.27 %	1'547'483.15	0.17	a)
XS2100269088	0.0100 % KHFC 0.01 02/05/25 REGS	4'000	0	4'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	1'250	0	1'250	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2100788780	0.4500 % GIS 0.45 01/15/26	1'150	0	0	1'150	EUR	102.16 %	1'269'792.12	0.14	a)
XS2101357072	0.7500 % FREGR 0 3/4 01/15/28 EMTN	2'700	0	700	2'000	EUR	103.29 %	2'232'586.80	0.25	a)
XS2102284622	0.1000 % BNG 0.1 01/15/30	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2102932055	0.5000 % MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN	2'600	0	800	1'800	EUR	103.51 %	2'013'724.73	0.22	a)
XS2104915033	0.1900 % NGGLN 0.19 01/20/25	1'200	0	0	1'200	EUR	101.16 %	1'312'031.12	0.15	a)
XS2105085208	0.0500 % COE 0.05 01/21/30 EMTN	5'000	0	5'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	2'350	0	2'350	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2106861771	1.1250 % BACRED 1 1/8 04/23/25 EMTN	600	0	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2107315470	0.6250 % ENIIM 0 5/8 01/23/30 EMTN	2'200	0	700	1'500	EUR	102.95 %	1'669'041.61	0.18	a)
XS2107435617	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 01/23/27 GMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS21096066XX	0.0500 % NEDWBK 0.05 01/28/30	2'700	0	2'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2110875957	0.0250 % ASIA 0.025 01/31/30	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2113121904	0.0500 % JFM 0.05 02/12/27 GMTN	0	1'100	1'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	0	2'400	0	2'400	EUR	101.31 %	2'627'771.48	0.29	a)
XS2123970167	0.2500 % VFC 0 1/4 02/25/28	0	600	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2126056204	0.0000 % PCAR 0 03/03/23 EMTN	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2126161764	0.5000 % RELLN 0 1/2 03/10/28	0	1'000	0	1'000	EUR	102.12 %	1'103'648.28	0.12	a)
XS2126169742	1.0000 % GIVNVX 1 04/22/27	0	300	0	300	EUR	106.32 %	344'728.51	0.04	a)
XS2128498636	2.0000 % LIGHT 2 05/11/24	0	1'000	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2135361686	1.3500 % MEX 1.35 09/18/27	0	1'100	1'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2156510021	1.0000 % SHBASS 1 04/15/25 EMTN	0	200	200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2156776309	0.5000 % ALTA 0 1/2 04/16/25	0	2'550	2'550	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2158820477	0.8290 % EIBKOR 0.829 04/27/25	0	700	700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2159791990	1.9500 % HNDA 1.95 10/18/24	0	900	900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2160861808	0.0100 % IBRD 0.01 04/24/28 GDIF	0	3'200	2'200	1'000	EUR	102.59 %	1'108'771.18	0.12	a)
XS2162004209	0.5000 % ONTTFT 0 1/2 05/06/25	0	3'300	3'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2167002521	0.7500 % SWEDA 0 3/4 05/05/25 EMTN	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2167007249	1.3380 % WFC 1.338 05/04/25 EMTN	0	1'650	1'650	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2168478068	1.2500 % CRHID 1 1/4 11/05/26 EMTN	0	800	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	0	1'500	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2168647357	1.3750 % SANTAN 1 3/8 01/05/26 EMTN	0	1'200	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2171253912	0.5000 % OPBANK 0 1/2 08/12/25 EMTN	0	2'600	2'600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2171316859	0.6250 % DANBNK 0 5/8 05/26/25 EMTN	0	3'700	3'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2171874519	0.5000 % NDASS 0 1/2 05/14/27 EMTN	0	2'200	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2173114542	0.5000 % SBAB 0 1/2 05/13/25 EMTN	0	600	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	0	2'150	0	2'150	EUR	104.67 %	2'432'260.18	0.27	a)
XS2176686546	0.4500 % CS 0.45 05/19/25 EMTN	0	1'400	400	1'000	EUR	102.49 %	1'107'722.82	0.12	a)
XS2177013765	0.7500 % RBLN 0 3/4 05/19/30 REGS	0	1'350	0	1'350	EUR	105.26 %	1'535'739.40	0.17	a)
XS2177580508	0.8750 % EOANGR 0 7/8 08/20/31 EMTN	0	1'400	0	1'400	EUR	106.75 %	1'615'254.48	0.18	a)
XS2178585423	2.1250 % CONGR 2 1/8 11/27/23 EMTN	0	900	0	900	EUR	105.81 %	1'029'166.40	0.11	a)
XS2178857285	2.7500 % ROMANI 2 3/4 02/26/26 REGS	0	1'300	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	0	1'500	0	1'500	EUR	108.14 %	1'753'196.46	0.19	a)
XS2181689659	1.7500 % REPHUN 1 3/4 06/05/35	0	550	550	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2182404298	0.7500 % BBVASM 0 3/4 06/04/25 GMTN	0	1'400	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2187689034	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	0	1'900	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2189931335	0.5500 % MET 0.55 06/16/27 GMTN	0	2'250	2'250	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2190134184	1.2500 % UCGIM 1 1/4 06/16/26 EMTN	0	2'350	2'350	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	0	1'900	900	1'000	EUR	106.78 %	1'154'034.20	0.13	a)
XS2193666042	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 06/23/29 EMTN	0	1'000	0	1'000	EUR	103.46 %	1'118'163.15	0.12	a)
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	0	1'000	0	1'000	EUR	105.33 %	1'138'362.91	0.13	a)
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	0	1'700	0	1'700	EUR	105.33 %	1'935'308.80	0.21	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	0	1'100	0	1'100	EUR	110.24 %	1'310'583.96	0.15	a)
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	0	2'200	0	2'200	EUR	107.09 %	2'546'293.71	0.28	a)
XS2198574209	1.7500 % HANRUE 1 3/4 10/08/40	0	1'200	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2199493169	0.0000 % POLAND 0 07/07/23 EMTN	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	0	2'400	2'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2206379567	2.2500 % AMCOSP 2 1/4 07/17/27 GMTN	0	450	450	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2210006339	0.5000 % LITHUN 0 1/2 07/28/50 EMTN	0	1'675	1'675	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/80	0	2'000	700	1'300	EUR	102.25 %	1'436'625.49	0.16	a)
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	0	1'300	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	0	1'700	0	1'700	EUR	103.77 %	1'906'573.05	0.21	a)
XS2225207468	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 03/03/27 EMTN	0	2'000	0	2'000	EUR	104.99 %	2'269'462.98	0.25	a)
XS2225428809	0.0000 % EIB 0 09/09/30	0	2'300	2'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	0	2'100	600	1'500	EUR	100.24 %	1'624'994.46	0.18	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2228260043	2.8750 % RYAI2 2 7/8 09/15/25 EMTN	0	600	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2230845328	0.0000 % FINNVE 0 09/15/27 EMTN	0	2'500	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2231330965	0.3750 % JCI 0 3/8 09/15/27	0	2'100	0	2'100	EUR	101.36 %	2'300'502.95	0.25	a)
XS2231331344	1.0000 % JCI 1 09/15/32	0	1'200	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	0	1'300	0	1'300	EUR	102.54 %	1'440'728.12	0.16	a)
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	0	2'600	0	2'600	EUR	99.66 %	2'800'471.31	0.31	a)
XS2234571771	1.3750 % BGARIA 1 3/8 09/23/50	0	1'000	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2235996217	0.0000 % NOVNVX 0 09/23/28	0	2'450	0	2'450	EUR	100.09 %	2'650'318.15	0.29	a)
XS2236363573	1.8750 % AMSSM 1 7/8 09/24/28 EMTN	0	2'700	2'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2237901355	0.3750 % TRNIM 0 3/8 09/25/30 EMTN	0	1'600	600	1'000	EUR	100.66 %	1'087'955.26	0.12	a)
XS2238342484	2.1250 % CTPBVV 2 1/8 10/01/25 EMTN	0	2'500	500	2'000	EUR	106.18 %	2'295'185.52	0.25	a)
XS2238789460	0.3750 % MDT 0 3/8 10/15/28	0	1'700	1'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2242633258	0.4000 % PEP 0.4 10/09/32	0	1'450	0	1'450	EUR	101.22 %	1'586'217.19	0.18	a)
XS2242747348	0.5410 % ASABRE 0.541 10/23/28	0	750	0	750	EUR	101.73 %	824'639.78	0.09	a)
XS2242924491	0.0000 % KUNTA 0 10/14/30 EMTN	0	1'100	1'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	0	800	0	800	EUR	106.25 %	918'662.15	0.10	a)
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	0	1'200	0	1'200	EUR	102.42 %	1'328'320.62	0.15	a)
XS2250026734	0.0000 % ICO 0 04/30/26 GMTN	0	1'200	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2250201329	0.0000 % Q 0 10/29/30 EMTN	0	3'000	2'000	1'000	EUR	100.23 %	1'083'275.60	0.12	a)
XS2251330184	0.1250 % IBRD 0 1/8 01/03/51 GMTN	0	1'850	1'850	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2251371022	0.0000 % EIB 0 03/28/28	0	3'500	1'000	2'500	EUR	103.63 %	2'799'920.12	0.31	a)
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	0	1'000	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2261215011	0.5000 % LHNVX 0 1/2 04/23/31	0	1'500	500	1'000	EUR	100.18 %	1'082'746.02	0.12	a)
XS2262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	0	1'400	0	1'400	EUR	98.61 %	1'492'073.77	0.17	a)
XS2262263622	0.0100 % ONT 0.01 11/25/30 EMTN	0	2'700	700	2'000	EUR	100.16 %	2'165'081.56	0.24	a)
XS2263684933	0.3750 % NESNVX 0 3/8 12/03/40	0	800	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2270142966	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 12/08/50 EMTN	0	1'300	0	1'300	EUR	97.18 %	1'365'335.14	0.15	a)
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	0	1'600	0	1'600	EUR	97.68 %	1'689'127.88	0.19	a)
XS2282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	0	2'900	0	2'900	EUR	99.45 %	3'116'863.96	0.35	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	0	1'100	0	1'100	EUR	98.61 %	1'172'272.35	0.13	a)
XS2286044370	0.0000 % ABBNVX 0 01/19/30 EMTN	0	1'300	0	1'300	EUR	99.50 %	1'397'931.44	0.15	a)
XS2287624584	0.1250 % MOTOPG 0 1/8 07/20/28 EMTN	0	1'100	0	1'100	EUR	100.23 %	1'191'531.83	0.13	a)
XS2287744135	0.2500 % CPPIBC 0 1/4 01/18/41 EMTN	0	1'400	0	1'400	EUR	99.20 %	1'500'970.74	0.17	a)
XS2287879733	0.0100 % EIB 0.01 05/15/41 EMTN	0	2'850	0	2'850	EUR	99.29 %	3'058'473.80	0.34	a)
XS2288097483	1.3500 % WIZZLN 1.35 01/19/24 EMTN	0	600	0	600	EUR	100.43 %	651'242.78	0.07	a)
XS2289133758	0.8500 % UCGIM 0.85 01/19/31 EMTN	0	3'900	1'400	2'500	EUR	99.48 %	2'688'005.45	0.30	a)
XS2289410420	0.2000 % IBRD 0.2 01/21/61	0	3'000	1'000	2'000	EUR	95.94 %	2'073'863.59	0.23	a)
XS2289587789	1.4500 % MEX 1.45 10/25/33	0	900	0	900	EUR	97.21 %	945'591.92	0.10	a)
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	0	2'450	0	2'450	EUR	101.46 %	2'686'488.58	0.30	a)
XS2290960520	1.6250 % TOTAL 1 5/8 PERP NC7	0	1'700	0	1'700	EUR	100.85 %	1'852'868.25	0.21	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	0	2'500	0	2'500	EUR	97.57 %	2'636'398.25	0.29	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	3'100	0	3'100	EUR	100.02 %	3'351'218.66	0.37	a)
EUR								254'718'743.50	28.22	
CH0550413337	2.2500 % CS 2 1/4 06/09/28 EMTN	0	650	0	650	GBP	105.39 %	836'829.94	0.09	a)
DE000LB2CQX3	1.5000 % LBBW 1 1/2 02/03/25	1'300	0	300	1'000	GBP	102.65 %	1'253'971.09	0.14	a)
FR0013451143	1.8750 % SOCGEN 1 7/8 10/03/24 EMTN	1'200	0	1'200	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013480027	1.2500 % BFCM 1 1/4 12/05/25	1'700	0	700	1'000	GBP	102.61 %	1'253'519.09	0.14	a)
FR0014001J59	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 12/07/27 EMTN	0	4'000	0	4'000	GBP	99.52 %	4'863'086.78	0.54	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	500	0	0	500	GBP	163.69 %	999'817.47	0.11	a)
GB00BJMHBS34	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	1'000	400	1'000	400	GBP	105.25 %	514'293.06	0.06	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	0	1'200	0	1'200	GBP	89.57 %	1'313'023.17	0.15	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	7'300	1'200	2'000	6'500	GBP	116.19 %	9'225'941.09	1.02	a)
XS0206361221	4.7500 % UKRAIL 4 3/4 11/29/35 EMTN	1'700	0	0	1'700	GBP	154.12 %	3'200'575.21	0.35	a)
XS0295479983	4.5000 % EIB 4 1/2 03/07/44 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	172.29 %	2'104'692.43	0.23	a)
XS0383001053	6.4500 % HTHROW 6.45 12/10/31 REGS	1'000	0	1'000	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	700	0	0	700	GBP	122.21 %	1'045'006.85	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	700	0	0	700	GBP	110.58 %	945'599.26	0.10	a)
XS2014278944	2.3750 % BRK 2 3/8 06/19/39	300	0	0	300	GBP	115.52 %	423'349.92	0.05	a)
XS2021481663	2.3750 % MOTOPG 2 3/8 07/03/39 EMTN	950	0	0	950	GBP	114.55 %	1'329'351.06	0.15	a)
XS2034715305	0.8750 % KFW 0 7/8 09/15/26 EMTN	1'500	0	1'500	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	3'300	0	2'300	1'000	GBP	104.59 %	1'277'621.24	0.14	a)
XS2057072121	2.0000 % CKHGTH 2 10/17/27	600	0	600	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2099267689	1.2500 % SDBC 1 1/4 01/21/23 EMTN	1'000	0	1'000	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2100904361	2.2500 % DANBNK 2 1/4 01/14/28 EMTN	1'500	0	1'500	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2106542165	1.7500 % CMZB 1 3/4 01/22/25 EMTN	2'200	0	2'200	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2107314663	0.7500 % IDAWBG 0 3/4 12/12/24	1'350	0	1'350	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2112815613	1.6250 % VW 1 5/8 02/10/24 EMTN	0	500	500	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	0	300	0	300	GBP	103.85 %	380'574.42	0.04	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	0	2'000	1'000	1'000	GBP	102.43 %	1'251'320.22	0.14	a)
XS2118502991	1.3750 % FABUH 1 3/8 02/19/23 EMTN	0	400	400	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2154336254	4.2500 % VW 4 1/4 10/09/25 EMTN	0	400	400	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2163020790	1.1250 % CPPIBC 1 1/8 12/14/29 EMTN	0	3'000	3'000	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2170601848	1.2500 % GSK 1 1/4 10/12/28 EMTN	0	1'600	0	1'600	GBP	102.97 %	2'012'510.60	0.22	a)
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	0	400	0	400	GBP	105.63 %	516'149.89	0.06	a)
XS2192430572	1.5000 % LLOYDS 1 1/2 06/23/23 EMTN	0	400	400	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	0	1'000	0	1'000	GBP	101.39 %	1'238'603.37	0.14	a)
XS2238341080	1.6250 % O 1 5/8 12/15/30 EMTN	0	500	0	500	GBP	104.33 %	637'265.30	0.07	a)
XS2244418609	1.0000 % ENELIM 1 10/20/27 EMTN	0	1'100	300	800	GBP	100.61 %	983'250.05	0.11	a)
XS2251337353	1.1250 % VZ 1 1/8 11/03/28	0	1'700	0	1'700	GBP	99.93 %	2'075'201.82	0.23	a)
XS2266989149	1.6250 % CBGLN 1 5/8 12/03/30 EMTN	0	1'300	0	1'300	GBP	101.39 %	1'610'168.51	0.18	a)
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	0	1'000	0	1'000	GBP	99.25 %	1'212'375.65	0.13	a)
XS2295280411	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 12/03/26 EMTN	0	1'150	0	1'150	GBP	99.43 %	1'396'830.95	0.15	a)
GBP								43'900'928.44	4.86	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN 300'000	300'000	0	0	300'000	JPY	99.85 %	2'545'243.34	0.28	a)
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	570'000	0	370'000	200'000	JPY	102.43 %	1'740'741.70	0.19	a)
JP1120231J51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/28 23	750'000	450'000	0	1'200'000	JPY	101.50 %	10'349'621.48	1.15	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	1'500'000	200'000	0	1'700'000	JPY	119.23 %	17'222'486.98	1.91	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	1'000'000	0	0	1'000'000	JPY	100.30 %	8'522'721.12	0.94	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	620'000	60'000	120'000	560'000	JPY	111.66 %	5'313'272.80	0.59	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	940'000	0	0	940'000	JPY	141.21 %	11'278'377.16	1.25	a)
XS0171578502	1.0500 % DBJP 1.05 06/20/23 INTL	200'000	25'000	0	225'000	JPY	102.40 %	1'957'665.27	0.22	a)
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	700'000	0	200'000	500'000	JPY	110.36 %	4'688'550.25	0.52	a)
XS0257403278	2.3000 % DBJP 2.3 03/19/26 INTL	500'000	110'000	0	610'000	JPY	111.59 %	5'783'992.08	0.64	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	20'000	80'000	0	100'000	JPY	116.33 %	988'420.50	0.11	a)
XS1092948618	1.0000 % GS 1 08/06/24 EMTN	140'000	0	0	140'000	JPY	103.84 %	1'235'268.59	0.14	a)
XS1288326967	0.4720 % JPM 0.472 09/11/20 EMTN	300'000	0	300'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	600'000	0	0	600'000	JPY	98.60 %	5'026'911.68	0.56	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	0	0	600'000	JPY	99.38 %	5'066'626.94	0.56	a)
XS1645683852	0.1830 % WMT 0.183 07/15/22	370'000	0	0	370'000	JPY	99.91 %	3'140'956.92	0.35	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	0	100'000	JPY	101.27 %	860'463.28	0.10	a)
XS1789478853	0.6400 % CHIEAS 0.64 03/16/21 EMTN	200'000	0	0	200'000	JPY	100.03 %	1'699'989.80	0.19	a)
XS1833010397	0.7220 % GLW 0.722 06/06/25	500'000	0	0	500'000	JPY	98.90 %	4'201'626.23	0.47	a)
XS1876097046	0.6600 % BNP 0.66 09/07/23 EMTN	600'000	100'000	300'000	400'000	JPY	99.84 %	3'393'236.33	0.38	a)
XS1942687184	0.8580 % RABOBK 0.858 01/31/29 GMTN	600'000	200'000	300'000	500'000	JPY	98.89 %	4'201'158.89	0.47	a)
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	0	600'000	0	600'000	JPY	100.84 %	5'140'959.22	0.57	a)
JPY								104'358'290.56	11.56	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	350'000	0	0	350'000	MXN	110.04 %	1'694'188.41	0.19	a)
MXN								1'694'188.41	0.19	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	2'000	0	0	2'000	MYR	103.33 %	454'793.00	0.05	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200	MYR	108.44 %	47'725.69	0.01	a)
MYR								502'518.69	0.06	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZGOVD0521C2	6.0000 % NZGB 6 05/15/21 0521	600	0	0	600	NZD	101.63 %	390'939.59	0.04	a)
NZD								390'939.59	0.04	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	1'000	2'000	0	3'000	PLN	138.84 %	996'239.12	0.11	a)
PL0000106126	5.2500 % POLGB 5 1/4 10/25/20 1020	5'000	0	5'000	0	PLN	0.00 %	0.00	0.00	
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	0	3'000	0	3'000	PLN	101.52 %	728'451.42	0.08	a)
PLN								1'724'690.54	0.19	
SE0001149311	5.0000 % SGB 5 12/01/20 #1047 1047	5'000	0	5'000	0	SEK	0.00 %	0.00	0.00	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000	SEK	153.87 %	821'565.60	0.09	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	6'200	0	0	6'200	SEK	105.21 %	696'597.97	0.08	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	0	5'000	0	5'000	SEK	106.87 %	570'635.93	0.06	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	0	5'000	0	5'000	SEK	100.21 %	535'043.60	0.06	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	0	10'000	0	10'000	SEK	101.37 %	1'082'549.33	0.12	a)
SEK								3'706'392.43	0.41	
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	400	0	0	400	SGD	105.83 %	283'765.71	0.03	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	400	0	0	400	SGD	125.28 %	335'917.68	0.04	a)
SGD								619'683.39	0.07	
TH0623033600	3.6250 % THAIGB 3 5/8 06/16/23	30'000	0	0	30'000	THB	107.46 %	958'217.91	0.11	a)
TH0623038302	5.6700 % THAIGB 5.67 03/13/28	9'000	0	0	9'000	THB	131.34 %	351'342.70	0.04	a)
THB								1'309'560.61	0.15	
BE6322164920	1.0000 % BELG 1 05/28/30 REGS	0	2'500	1'500	1'000	USD	97.93 %	871'203.07	0.10	a)
US00206RKF81	3.5000 % T 3 1/2 02/01/61	0	850	850	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US00254EMX75	1.7500 % SEK 1 3/4 12/12/23 GMTN	2'100	0	1'100	1'000	USD	104.16 %	926'580.67	0.10	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABV 3.2 11/21/29	0	3'500	0	3'500	USD	110.67 %	3'445'821.12	0.38	a)
US00507UAF84	3.8500 % AGN 3.85 06/15/24	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	500	0	0	500	USD	106.74 %	474'779.52	0.05	a)
US00828EDC03	3.0000 % AFDB 3 09/20/23	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US00828EEA38	1.6250 % AFDB 1 5/8 09/16/22 GMTN	4'000	0	4'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	2'325	0	0	2'325	USD	108.17 %	2'237'301.74	0.25	a)
US013051EF00	2.9500 % ALTA 2.95 01/23/24	2'200	0	2'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US013051EK94	1.0000 % ALTA 1 05/20/25	0	2'000	500	1'500	USD	101.68 %	1'356'857.95	0.15	a)
US01609WAV46	4.2000 % BABA 4.2 12/06/47	1'300	0	1'300	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	0	600	0	600	USD	90.53 %	483'191.58	0.05	a)
US02079KAH05	0.4500 % GOOGL 0.45 08/15/25	0	1'000	0	1'000	USD	99.65 %	886'450.82	0.10	a)
US025816BW85	3.7000 % AXP 3.7 08/03/23	2'600	0	0	2'600	USD	108.03 %	2'498'690.69	0.28	a)
US03027XAQ34	3.0000 % AMT 3 06/15/23	850	0	0	850	USD	105.80 %	800'039.96	0.09	a)
US03027XAX84	2.7500 % AMT 2 3/4 01/15/27	2'300	0	0	2'300	USD	107.75 %	2'204'589.82	0.24	a)
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	0	1'000	0	1'000	USD	99.47 %	884'858.43	0.10	a)
US031162BV19	3.6250 % AMGN 3 5/8 05/22/24	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US031162BY57	3.1250 % AMGN 3 1/8 05/01/25	1'000	0	0	1'000	USD	109.30 %	972'350.59	0.11	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	0	2'800	0	2'800	USD	103.97 %	2'589'792.84	0.29	a)
US032654AH86	2.8750 % ADI 2 7/8 06/01/23	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US037411BF15	4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	1'950	0	1'450	500	USD	98.65 %	438'781.86	0.05	a)
US045167EF60	2.2500 % ASIA 2 1/4 01/20/21 GMTN	750	0	750	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US04522KAA43	2.2500 % AIIB 2 1/4 05/16/24	3'500	0	2'000	1'500	USD	106.37 %	1'419'334.56	0.16	a)
US04522KAC09	0.2500 % AIIB 0 1/4 09/29/23	0	2'600	1'200	1'400	USD	100.05 %	1'246'062.84	0.14	a)
US05565QDN51	3.2790 % BPLN 3.279 09/19/27	1'300	0	1'300	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	0	3'400	1'800	1'600	USD	106.27 %	1'512'647.37	0.17	a)
US05578UAB08	5.1500 % BPCEGP 5.15 07/21/24 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	113.56 %	1'010'238.66	0.11	a)
US05968AAG13	2.7040 % BANCO 2.704 01/09/25 REGS	850	0	0	850	USD	105.77 %	799'790.43	0.09	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	0	600	0	600	USD	100.99 %	539'017.54	0.06	a)
US06051GGZ63	3.3660 % BAC 3.366 01/23/26	2'400	0	2'400	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	0	1'650	0	1'650	USD	104.36 %	1'531'764.43	0.17	a)
US06738EBM66	2.6450 % BACR 2.645 06/24/31	0	1'800	1'800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	0	2'200	0	2'200	USD	102.87	2'013'269.77	0.22	a)
US09659X2E17	3.5000 % BNP 3 1/2 03/01/23 REGS	3'700	0	1'700	2'000	USD	106.19	1'889'314.69	0.21	a)
US09659X2N16	1.3230 % BNP 1.323 01/13/27 REGS	0	1'400	0	1'400	USD	100.25	1'248'603.42	0.14	a)
US09660V2C60	2.8240 % BNP 2.824 01/26/41 REGS	0	2'400	0	2'400	USD	97.90	2'090'140.11	0.23	a)
US10112RBB96	3.4000 % BXP 3.4 06/21/29	1'550	0	0	1'550	USD	110.64	1'525'537.68	0.17	a)
US10373QBG47	3.0000 % BPLN 3 02/24/50	0	2'100	2'100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	0	1'250	0	1'250	USD	114.21	1'269'992.96	0.14	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	0	300	0	300	USD	123.78	330'346.73	0.04	a)
US110709AD48	1.7500 % BRCOL 1 3/4 09/27/24 10	1'500	0	1'500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US110709AE21	1.3000 % BRCOL 1.3 01/29/31	0	4'000	0	4'000	USD	99.96	3'556'869.89	0.39	a)
US11135FAT84	3.1500 % AVGO 3.15 11/15/25 144A	0	1'000	1'000	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US11135FBB67	3.1500 % AVGO 3.15 11/15/25	0	1'000	0	1'000	USD	108.52	965'429.50	0.11	a)
US124857AP86	3.5000 % VIAC 3 1/2 01/15/25	1'850	0	1'850	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US126650DE72	2.6250 % CVS 2 5/8 08/15/24	2'000	0	0	2'000	USD	106.80	1'900'132.22	0.21	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	0	1'000	0	1'000	USD	99.15	881'993.92	0.10	a)
US12673PAE51	4.5000 % CA 4 1/2 08/15/23	250	0	250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US135087H643	2.0000 % CANADA 2 11/15/22	400	0	400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US135087J706	2.6250 % CANADA 2 5/8 01/25/22	700	0	700	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US135087K787	1.6250 % CANADA 1 5/8 01/22/25	1'140	0	0	1'140	USD	104.98	1'064'688.94	0.12	a)
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	0	900	0	900	USD	100.86	807'541.52	0.09	a)
US136375BL52	6.2500 % CNRCN 6 1/4 08/01/34	2'000	0	0	2'000	USD	150.31	2'674'244.35	0.30	a)
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	1'250	0	0	1'250	USD	119.31	1'326'749.44	0.15	a)
US149123CF65	3.2500 % CAT 3 1/4 09/19/49	1'200	0	0	1'200	USD	112.89	1'205'080.63	0.13	a)
US15089QAJ31	3.5000 % CE 3 1/2 05/08/24	900	0	0	900	USD	108.12	865'683.99	0.10	a)
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	0	1'600	0	1'600	USD	103.19	1'468'793.65	0.16	a)
US17275RAV42	3.0000 % CSCO 3 06/15/22	1'550	0	1'550	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	2'000	0	0	2'000	USD	110.87	1'972'545.66	0.22	a)
US172967MF56	3.3520 % C 3.352 04/24/25	2'700	0	0	2'700	USD	108.16	2'597'988.73	0.29	a)
US191216CU25	1.4500 % KO 1.45 06/01/27	0	500	500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	800	0	0	800	USD	106.72	759'476.43	0.08	a)
US20030NBN03	3.3750 % CMCSA 3 3/8 08/15/25	3'500	0	3'500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	0	2'900	0	2'900	USD	97.16	2'506'495.15	0.28	a)
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	0	1'000	0	1'000	USD	92.56	823'387.07	0.09	a)
US205887BR27	3.2000 % CAG 3.2 01/25/23	250	0	250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US219868BS46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	2'000	0	2'000	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US219868CC84	2.3750 % CAF 2 3/8 05/12/23	0	2'900	2'900	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US222213AR10	2.6250 % COE 2 5/8 02/13/23	1'200	0	1'200	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US222213AU49	1.3750 % COE 1 3/8 02/27/25	0	4'300	1'300	3'000	USD	103.86	2'771'842.37	0.31	a)
US222213AV22	0.2500 % COE 0 1/4 06/10/23	0	1'500	0	1'500	USD	100.07	1'335'320.74	0.15	a)
US225433AC55	3.7500 % CS 3 3/4 03/26/25	0	1'000	0	1'000	USD	110.70	984'813.89	0.11	a)
US22822VAJ08	3.1500 % CCI 3.15 07/15/23	2'100	0	1'100	1'000	USD	106.17	944'488.32	0.10	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	0	3'200	0	3'200	USD	101.60	2'892'295.99	0.32	a)
US23636BAV18	3.2440 % DANBNK 3.244 12/20/25 REGS	900	0	900	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US24023NAA00	4.5200 % DBSSP 4.52 12/11/28 REGS	350	0	350	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	2'500	0	0	2'500	USD	155.79	3'464'836.32	0.38	a)
US25243YAY59	3.5000 % DGELN 3 1/2 09/18/23	1'400	0	0	1'400	USD	107.69	1'341'152.06	0.15	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	0	650	0	650	USD	102.49	592'626.61	0.07	a)
US25243YBE86	2.1250 % DGELN 2 1/8 04/29/32	0	1'100	0	1'100	USD	102.81	1'006'008.61	0.11	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	0	1'200	0	1'200	USD	104.14	1'111'693.98	0.12	a)
US254687GA88	3.8000 % DIS 3.8 05/13/60	0	400	0	400	USD	118.17	420'485.45	0.05	a)
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	650	0	0	650	USD	106.11	613'582.03	0.07	a)
US29250NBA28	4.0000 % ENBCN 4 11/15/49	900	0	900	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US29278NAQ60	3.7500 % ETP 3 3/4 05/15/30	800	0	800	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US29874QAY08	1.6250 % EBRD 1 5/8 09/27/24	3'400	0	3'400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US29874QEH39	0.2500 % EBRD 0 1/4 07/10/23 GMTN	0	1'500	0	1'500	USD	100.05	1'335'013.96	0.15	a)
US298785HR03	2.8750 % EIB 2 7/8 08/15/23 GMTN	2'500	0	0	2'500	USD	106.75	2'374'142.24	0.26	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US298785HT68	3.1250 % EIB 3 1/8 12/14/23 GMTN	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US298785HZ29	1.3750 % EIB 1 3/8 09/06/22	700	0	700	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US298785JB33	1.6250 % EIB 1 5/8 03/14/25	1'000	0	0	1'000	USD	104.99 %	934'026.62	0.10	a)
US298785JJ68	0.6250 % EIB 0 5/8 10/21/27	0	1'000	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	0	2'110	0	2'110	USD	99.14 %	1'860'894.55	0.21	a)
US30216BHK17	1.7500 % EDC 1 3/4 07/18/22	4'000	0	4'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US30231GAF90	2.7090 % XOM 2.709 03/06/25	1'800	0	0	1'800	USD	107.28 %	1'717'853.18	0.19	a)
US377372AH03	2.8000 % GSK 2.8 03/18/23	250	0	0	250	USD	105.16 %	233'866.94	0.03	a)
US404280BA69	3.6000 % HSBC 3.6 05/25/23	1'900	0	0	1'900	USD	107.27 %	1'813'086.64	0.20	a)
US404280CJ69	1.6450 % HSBC 1.645 04/18/26	0	900	0	900	USD	102.06 %	817'125.18	0.09	a)
US404280CL16	2.0130 % HSBC 2.013 09/22/28	0	2'600	0	2'600	USD	101.95 %	2'358'039.59	0.26	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	0	2'450	0	2'450	USD	109.79 %	2'392'982.19	0.27	a)
US4581XOCF37	3.0000 % IADB 3 02/21/24	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US4581XODG01	2.2500 % IADB 2 1/4 06/18/29	3'600	0	1'600	2'000	USD	109.58 %	1'949'647.36	0.22	a)
US4581XODK13	1.7500 % IADB 1 3/4 03/14/25 GMTN	1'900	0	1'900	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US4581XODN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	0	3'200	0	3'200	USD	100.64 %	2'865'052.59	0.32	a)
US4581XODQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	0	4'000	2'000	2'000	USD	98.55 %	1'753'454.98	0.19	a)
US4581XODS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	0	3'250	0	3'250	USD	99.00 %	2'862'201.26	0.32	a)
US459058DT78	2.2500 % IBRD 2 1/4 06/24/21 GDIF	600	0	600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058DX80	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/25/24 GDIF	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058GE72	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/22/27 GDIF	850	0	0	850	USD	110.79 %	837'711.86	0.09	a)
US459058HJ50	1.7500 % IBRD 1 3/4 10/23/29 GDIF	3'500	0	1'500	2'000	USD	105.22 %	1'872'092.03	0.21	a)
US459058HT33	1.6250 % IBRD 1 5/8 01/15/25	4'900	0	3'900	1'000	USD	104.88 %	933'048.06	0.10	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	0	1'800	300	1'500	USD	100.85 %	1'345'782.43	0.15	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	0	3'120	1'120	2'000	USD	99.55 %	1'771'158.02	0.20	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	0	2'300	1'400	900	USD	99.97 %	800'423.83	0.09	a)
US459058JN45	0.7500 % IBRD 0 3/4 11/24/27	0	1'900	0	1'900	USD	99.28 %	1'678'104.08	0.19	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	0	1'600	0	1'600	USD	102.84 %	1'463'811.89	0.16	a)
US459500KCP30	2.8750 % IFC 2 7/8 07/31/23 GMTN	1'750	0	0	1'750	USD	106.62 %	1'659'797.89	0.18	a)
US459500VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	2'000	0	0	2'000	USD	107.93 %	1'920'201.60	0.21	a)
US465410AH18	6.8750 % ITALY 6 7/8 09/27/23	4'000	0	2'000	2'000	USD	115.96 %	2'063'178.11	0.23	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	3'400	0	1'400	2'000	USD	127.67 %	2'271'486.85	0.25	a)
US465410BX58	2.3750 % ITALY 2 3/8 10/17/24	3'500	0	2'000	1'500	USD	105.26 %	1'404'642.82	0.16	a)
US465410BZ07	4.0000 % ITALY 4 10/17/49	4'000	0	1'000	3'000	USD	109.30 %	2'917'025.09	0.32	a)
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	0	4'000	0	4'000	USD	99.52 %	3'541'141.76	0.39	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	2'500	0	0	2'500	USD	109.95 %	2'445'332.48	0.27	a)
US471048BS61	3.2500 % JBC 3 1/4 07/20/23	1'250	0	0	1'250	USD	107.14 %	1'191'341.20	0.13	a)
US478160CJ19	2.6250 % JNJ 2 5/8 01/15/25	825	0	0	825	USD	107.83 %	791'407.95	0.09	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	0	1'100	0	1'100	USD	99.75 %	976'152.74	0.11	a)
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	1'100	0	0	1'100	USD	107.45 %	1'051'443.15	0.12	a)
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	0	600	0	600	USD	100.62 %	537'069.37	0.06	a)
US50064FAR55	2.0000 % KOREA 2 06/19/24	2'000	0	0	2'000	USD	105.18 %	1'871'433.73	0.21	a)
US500769JC98	1.3750 % KFW 1 3/8 08/05/24	4'250	0	3'250	1'000	USD	103.72 %	922'666.43	0.10	a)
US500769JD71	1.7500 % KFW 1 3/4 09/14/29	3'600	0	3'600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US500769JF20	0.3750 % KFW 0 3/8 07/18/25	0	1'000	0	1'000	USD	99.62 %	886'246.21	0.10	a)
US500769JG03	0.7500 % KFW 0 3/4 09/30/30	0	2'650	1'650	1'000	USD	96.21 %	855'919.74	0.09	a)
US500769JH85	0.2500 % KFW 0 1/4 10/19/23	0	2'000	1'000	1'000	USD	100.06 %	890'151.55	0.10	a)
US501044DQ10	1.7000 % KR 1.7 01/15/31	0	1'000	0	1'000	USD	99.10 %	881'620.29	0.10	a)
US515110BT00	2.5000 % RENTEN 2 1/2 11/15/27 37	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US515110BV55	3.1250 % RENTEN 3 1/8 11/14/23	1'250	0	1'250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US515110BY94	0.8750 % RENTEN 0 7/8 09/03/30	0	4'100	0	4'100	USD	97.05 %	3'539'799.35	0.39	a)
US532457BV93	3.3750 % LLY 3 3/8 03/15/29	400	0	0	400	USD	114.81 %	408'536.35	0.05	a)
US53944YAC75	3.0000 % LLOYDS 3 01/11/22	1'950	0	1'950	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	0	750	0	750	USD	105.31 %	702'608.30	0.08	a)
US563469UU76	2.6000 % MP 2.6 04/16/24 GX	500	0	0	500	USD	107.01 %	475'980.48	0.05	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	0	1'800	0	1'800	USD	107.62 %	1'723'361.59	0.19	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	1'100	0	0	1'100	USD	119.73 %	1'171'600.53	0.13	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US58013MEM29	2.6250 % MCD 2 5/8 01/15/22 MTN	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	0	600	0	600	USD	103.22 %	550'957.75	0.06	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	0	2'000	0	2'000	USD	99.84 %	1'776'388.86	0.20	a)
US58933YAU91	2.9000 % MRK 2.9 03/07/24	500	0	500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	0	3'000	0	3'000	USD	98.91 %	2'639'656.70	0.29	a)
US59156RBH03	3.6000 % MET 3.6 04/10/24	500	150	0	650	USD	109.76 %	634'647.31	0.07	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	0	1'800	0	1'800	USD	99.89 %	1'599'550.62	0.18	a)
US63307A2M63	0.5500 % NACN 0.55 11/15/24 MTN	0	1'500	0	1'500	USD	100.03 %	1'334'760.29	0.15	a)
US63859VBF76	1.0000 % NWISE 1 08/28/25 REGS	0	1'900	0	1'900	USD	100.29 %	1'695'158.60	0.19	a)
US642869AM37	3.6250 % NBRNS 3 5/8 02/24/28	1'500	0	0	1'500	USD	116.59 %	1'555'710.24	0.17	a)
US65562QBM69	1.3750 % NIB 1 3/8 10/17/22	3'100	0	3'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US65562QBQ73	0.5000 % NIB 0 1/2 01/21/26 GMTN	0	2'850	0	2'850	USD	99.80 %	2'530'187.87	0.28	a)
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	0	1'000	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	0	1'100	0	1'100	USD	104.87 %	1'026'215.87	0.11	a)
US674599CW33	2.9000 % OXY 2.9 08/15/24	2'500	0	2'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US676167BX63	3.1250 % OKB 3 1/8 11/07/23	1'250	0	1'250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US676167BY47	2.6250 % OKB 2 5/8 01/31/22	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US676167BZ12	1.6250 % OKB 1 5/8 09/17/22	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US676167CC18	0.5000 % OKB 0 1/2 02/02/26 GMTN	0	2'900	0	2'900	USD	99.64 %	2'570'500.98	0.28	a)
US682680AZ68	4.4500 % OKE 4.45 09/01/49	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US683234AQ19	1.0500 % ONT 1.05 05/21/27	0	2'300	0	2'300	USD	101.03 %	2'067'072.78	0.23	a)
US683234AS74	0.6250 % ONT 0 5/8 01/21/26	0	2'160	0	2'160	USD	99.87 %	1'919'038.00	0.21	a)
US683234C895	1.7500 % ONT 1 3/4 01/24/23	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US683234AFG40	2.0000 % ONT 2 10/02/29	4'000	0	1'500	2'500	USD	105.79 %	2'352'725.12	0.26	a)
US68329AAH14	1.2500 % ONTFTT 1 1/4 09/27/30 144A	0	2'700	0	2'700	USD	98.00 %	2'353'905.62	0.26	a)
US68389XBB01	2.5000 % ORCL 2 1/2 05/15/22	2'250	0	750	1'500	USD	102.47 %	1'367'306.30	0.15	a)
US713448DY13	3.0000 % PEP 3 10/15/27	1'850	0	400	1'450	USD	111.70 %	1'440'879.34	0.16	a)
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	2'000	0	0	2'000	USD	105.45 %	1'876'113.02	0.21	a)
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	0	1'250	0	1'250	USD	100.22 %	1'114'446.40	0.12	a)
US715638DE95	2.3920 % PERU 2.392 01/23/26	0	500	0	500	USD	105.99 %	471'421.28	0.05	a)
US717081EY56	1.7000 % PFE 1.7 05/28/30	0	800	0	800	USD	101.24 %	720'526.18	0.08	a)
US718172AT63	2.5000 % PM 2 1/2 08/22/22	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US718172CA54	2.3750 % PM 2 3/8 08/17/22	1'850	0	1'850	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US74005PBT03	1.1000 % LIN 1.1 08/10/30	0	1'900	0	1'900	USD	96.26 %	1'627'041.93	0.18	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	0	2'800	0	2'800	USD	99.71 %	2'483'681.36	0.28	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	5'000	0	0	5'000	USD	112.42 %	5'000'530.56	0.55	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	0	900	0	900	USD	104.73 %	838'510.27	0.09	a)
US748148RZ80	1.5000 % Q 1 1/2 02/11/25 QX	0	3'000	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	0	3'200	900	2'300	USD	100.36 %	2'053'384.71	0.23	a)
US748149AG65	2.6250 % Q 2 5/8 02/13/23	3'000	0	1'000	2'000	USD	104.82 %	1'864'921.86	0.21	a)
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	1'500	0	0	1'500	USD	106.80 %	1'425'152.54	0.16	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	0	3'100	0	3'100	USD	100.14 %	2'761'593.29	0.31	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	3'000	0	1'000	2'000	USD	106.91 %	1'902'142.72	0.21	a)
US78015K7H17	1.1500 % RY 1.15 06/10/25 MTN	0	1'000	0	1'000	USD	101.66 %	904'322.88	0.10	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	3'500	0	0	3'500	USD	115.13 %	3'584'812.22	0.40	a)
US817826AF77	2.5000 % SVELEV 2 1/2 02/10/41 144A	0	1'150	0	1'150	USD	98.86 %	1'011'418.27	0.11	a)
US822582CF79	2.3750 % RDSALN 2 3/8 04/06/25	0	200	200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US824348BJ44	2.9500 % SHW 2.95 08/15/29	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US824348BK17	3.8000 % SHW 3.8 08/15/49	2'500	0	0	2'500	USD	116.52 %	2'591'471.52	0.29	a)
US82937TAA07	3.1250 % SINOPC 3 1/8 04/24/23 144A	500	0	500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US83368TAU25	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/16/24 REGS	3'000	0	1'500	1'500	USD	105.52 %	1'408'005.50	0.16	a)
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	0	2'850	0	2'850	USD	100.41 %	2'545'780.33	0.28	a)
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	0	1'300	0	1'300	USD	105.81 %	1'223'671.49	0.14	a)
US85771PAF99	3.1500 % EQNR 3.15 01/23/22	1'500	0	500	1'000	USD	102.81 %	914'606.66	0.10	a)
US85771PAP71	2.9000 % EQNR 2.9 11/08/20	1'300	0	1'300	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	0	1'700	0	1'700	USD	100.99 %	1'527'246.75	0.17	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US88032XAG97	3.5950 % TENCNT 3.595 01/19/28 REGS	800	0	800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US88032XAN49	3.9750 % TENCNT 3.975 04/11/29 REGS	450	0	450	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US89114QCB23	3.2500 % TD 3 1/4 03/11/24 GMTN	3'100	0	3'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US89114QCH92	1.1500 % TD 1.15 06/12/25 MTN	0	2'100	2'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US89114QCP19	0.7500 % TD 0 3/4 01/06/26 MTN	0	1'850	0	1'850	USD	99.64 %	1'639'901.09	0.18	a)
US89153VAQ23	3.4550 % TOTAL 3.455 02/19/29	3'700	0	1'200	2'500	USD	113.26 %	2'518'946.88	0.28	a)
US892331AC30	3.4190 % TOYOTA 3.419 07/20/23	1'650	0	0	1'650	USD	107.50 %	1'577'898.64	0.17	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	0	750	0	750	USD	98.96 %	660'274.46	0.07	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	5'000	0	2'000	3'000	USD	142.88 %	3'813'048.00	0.42	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	15'000	10'000	16'000	9'000	USD	131.39 %	10'519'658.60	1.17	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	17'500	7'500	22'000	3'000	USD	119.19 %	3'180'876.00	0.35	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	2'000	8'000	0	10'000	USD	109.97 %	9'782'820.00	1.08	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	500	0	0	500	USD	106.78 %	474'963.00	0.05	a)
US912828S356	1.3750 % T 1 3/8 06/30/23	3'200	0	0	3'200	USD	102.94 %	2'930'342.40	0.32	a)
US912828XW50	1.7500 % T 1 3/4 06/30/22	7'500	0	4'500	3'000	USD	102.31 %	2'730'516.00	0.30	a)
US91324PCN06	3.3500 % UNH 3.35 07/15/22	250	0	0	250	USD	104.34 %	232'061.06	0.03	a)
US91324PDS83	2.8750 % UNH 2 7/8 08/15/29	700	0	0	700	USD	110.72 %	689'450.68	0.08	a)
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	500	0	0	500	USD	113.50 %	504'843.55	0.06	a)
US91324PDX78	2.0000 % UNH 2 05/15/30	0	600	0	600	USD	103.34 %	551'571.57	0.06	a)
US91533BAF76	4.0000 % VTRS 4 06/22/50 144A	0	400	0	400	USD	111.44 %	396'544.54	0.04	a)
US92277GAN79	4.4000 % VTR 4.4 01/15/29	1'450	0	0	1'450	USD	115.92 %	1'495'210.77	0.17	a)
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	765	0	0	765	USD	117.08 %	796'760.50	0.09	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	3'100	0	1'500	1'600	USD	110.34 %	1'570'521.19	0.17	a)
US931142DH37	2.5500 % WMT 2.55 04/11/23	1'500	0	0	1'500	USD	104.41 %	1'393'287.07	0.15	a)
US931142ED14	3.5500 % WMT 3.55 06/26/25	1'900	0	0	1'900	USD	112.42 %	1'900'235.42	0.21	a)
US931142EM13	3.0500 % WMT 3.05 07/08/26	1'000	0	0	1'000	USD	111.69 %	993'620.93	0.11	a)
US94974BEV80	4.6000 % WFC 4.6 04/01/21 MTN	2'200	0	2'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US94974BFJ44	3.4500 % WFC 3.45 02/13/23 M	500	0	500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	750	0	0	750	USD	110.06 %	734'313.65	0.08	a)
US98956PAL67	3.1500 % ZBH 3.15 04/01/22	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USC68012AA85	2.5000 % OMERFT 2 1/2 05/02/24 REGS	3'500	0	0	3'500	USD	106.48 %	3'315'392.42	0.37	a)
USG0398NZ620	2.3750 % ANTOLN 2 3/8 10/14/30 REGS	0	300	0	300	USD	101.53 %	270'971.27	0.03	a)
USG0446NAM68	3.6250 % AALLN 3 5/8 09/11/24 REGS	2'200	0	2'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USG0446NAP99	4.5000 % AALLN 4 1/2 03/15/28 REGS	2'800	0	1'000	1'800	USD	117.37 %	1'879'374.30	0.21	a)
USG8201NAG72	2.5000 % SINOPE 2 1/2 09/13/22 REGS	3'600	0	1'100	2'500	USD	102.41 %	2'277'509.44	0.25	a)
USG8850LAA82	3.7000 % YANTZE 3.7 06/10/25 REGS	1'050	0	1'050	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USH4209BT36	1.3640 % UBS 1.364 01/30/27 REGS	0	1'250	0	1'250	USD	100.97 %	1'122'741.92	0.12	a)
USH4209UAC02	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 REGS	0	2'500	700	1'800	USD	116.72 %	1'869'030.03	0.21	a)
USN39427AQ76	2.7500 % HEIANA 2 3/4 04/01/23 REGS	0	2'000	0	2'000	USD	104.80 %	1'864'619.39	0.21	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	0	4'000	1'400	2'600	USD	101.47 %	2'346'937.38	0.26	a)
USP16260AA28	5.0000 % BCOCPE 5 08/26/22 REGS	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USQ25738AA54	4.5000 % CNOOC 4 1/2 10/03/23 REGS	2'700	0	2'700	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	1'500	0	0	1'500	USD	107.34 %	1'432'358.30	0.16	a)
USU0029QAV87	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29 REGS	3'500	0	3'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU07265AC20	3.8750 % BAYNGR 3 7/8 12/15/23 REGS	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU11009BB98	3.4000 % BMV 3.4 07/26/29 REGS	1'250	0	1'250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU11009BC71	4.1250 % BMV 4 1/8 06/15/39 REGS	300	0	300	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU37818AU27	4.1250 % GLENLN 4 1/8 03/12/24 REGS	400	0	400	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU74078BY87	3.5000 % NESNVX 3 1/2 09/24/25 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	112.11 %	997'357.25	0.11	a)
USU74078CD32	4.0000 % NESNVX 4 09/24/48 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	125.58 %	1'117'159.68	0.12	a)
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	0	2'500	0	2'500	USD	107.94 %	2'400'585.60	0.27	a)
USU88868AJ08	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31 REGS	0	3'000	0	3'000	USD	102.65 %	2'739'576.58	0.30	a)
USY68856AM84	3.1250 % PETMK 3 1/8 03/18/22 REGS	1'950	0	0	1'950	USD	103.03 %	1'787'282.02	0.20	a)
USY7140WAA63	5.2300 % IDASAL 5.23 11/15/21 REGS	1'400	0	1'400	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS0043037505	7.3750 % AFDDB 7 3/8 04/06/23	3'000	0	0	3'000	USD	115.05 %	3'070'374.34	0.34	a)
XS0782720402	4.3750 % SLOVAK 4 3/8 05/21/22 REGS	1'600	0	1'600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS0922882344	3.7500 % ONGCIN 3 3/4 05/07/23	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1310991424	2.3830 % APICOR 2.383 10/28/20	1'500	0	1'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1485745704	2.1250 % QNBK 2 1/8 09/07/21 EMTN	3'500	0	3'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1605679296	2.5000 % TOKYO 2 1/2 06/08/22 REGS	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1711039591	2.7500 % SDBC 2 3/4 11/16/22 EMTN	4'000	0	1'000	3'000	USD	103.87 %	2'771'949.12	0.31	a)
XS1717575259	2.3750 % NESNVX 2 3/8 11/17/22 EMTN	4'600	0	1'600	3'000	USD	103.81 %	2'770'347.84	0.31	a)
XS1748257851	2.5000 % KBN 2 1/2 01/11/23 REGS	1'200	0	1'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1800010693	4.0000 % ADCBUH 4 03/29/23 REGS	2'600	0	0	2'600	USD	106.51 %	2'463'626.21	0.27	a)
XS1837054581	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 11/15/21 EMTN	800	0	800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1865126004	3.1250 % DBJJP 3 1/8 09/06/23 REGS	1'200	0	0	1'200	USD	107.07 %	1'142'961.64	0.13	a)
XS1865437930	3.8750 % STSP 3 7/8 08/28/28 EMTN	1'300	600	600	1'300	USD	115.39 %	1'334'439.14	0.15	a)
XS1937715305	2.6250 % KOMINS 2 5/8 09/15/22 REGS	1'700	0	1'700	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2045821811	1.7500 % DBJJP 1 3/4 08/28/24 REGS	3'000	0	0	3'000	USD	104.52 %	2'789'403.07	0.31	a)
XS2049422343	4.2500 % SRENVX 4 1/4 PERP	1'200	0	1'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2049827160	1.5000 % BNG 1 1/2 09/06/22 REGS	700	0	700	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2063540038	4.7000 % BOAD 4.7 10/22/31 REGS	1'400	0	1'400	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2065581212	1.5000 % BNG 1 1/2 10/16/24 REGS	1'200	0	1'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2068940753	1.6250 % FINNVE 1 5/8 10/23/24 REGS	1'300	0	1'300	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2081157401	1.6250 % KOMINS 1 5/8 04/24/23 REGS	2'800	0	2'800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2101563646	1.7500 % NEDWBK 1 3/4 01/15/25 REGS	2'600	0	2'600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2156607884	0.7500 % BNG 0 3/4 04/17/23 REGS	0	1'600	0	1'600	USD	101.17 %	1'440'056.01	0.16	a)
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	0	850	0	850	USD	101.48 %	767'328.48	0.08	a)
XS2177026155	0.8750 % FINL 0 7/8 05/20/30 REGS	0	2'500	0	2'500	USD	97.32 %	2'164'441.28	0.24	a)
XS2180643889	1.0000 % NEDWBK 1 05/28/30 REGS	0	2'600	2'600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2186093766	1.8750 % CHMEDA 1 7/8 06/17/25	0	600	0	600	USD	100.81 %	538'078.17	0.06	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	98.79 %	878'791.36	0.10	a)
XS2218776248	0.2500 % KOMINS 0 1/4 12/01/22 REGS	0	400	0	400	USD	100.09 %	356'163.81	0.04	a)
XS2224639802	0.6250 % JFM 0 5/8 09/02/25 REGS	0	2'250	0	2'250	USD	99.54 %	1'992'452.69	0.22	a)
XS2225366694	0.8500 % SEB 0.85 09/02/25 REGS	0	3'000	0	3'000	USD	100.31 %	2'676'939.84	0.30	a)
XS2226989015	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 REGS	0	800	0	800	USD	99.26 %	706'413.57	0.08	a)
XS2230306537	2.0000 % COMQAT 2 09/15/25 EMTN	0	2'800	0	2'800	USD	101.04 %	2'516'810.06	0.28	a)
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	0	3'300	0	3'300	USD	101.19 %	2'970'614.59	0.33	a)
XS2233217558	1.7100 % EDPPL 1.71 01/24/28 REGS	0	1'150	0	1'150	USD	99.89 %	1'021'894.20	0.11	a)
XS2233264550	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 REGS	0	1'600	0	1'600	USD	99.23 %	1'412'371.66	0.16	a)
XS2237442574	0.6250 % NDEVBB 0 5/8 09/29/25 EMTN	0	2'000	0	2'000	USD	99.66 %	1'773'186.30	0.20	a)
XS2247546711	1.0000 % CADES 1 10/21/30 REGS	0	5'000	1'500	3'500	USD	97.45 %	3'034'234.34	0.34	a)
XS2249473724	0.6250 % KOLAHO 0 5/8 11/03/23 GMTN	0	400	0	400	USD	100.58 %	357'907.43	0.04	a)
XS2249779302	0.1250 % DENK 0 1/8 10/27/22 REGS	0	1'000	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2251170390	0.1250 % KOMINS 0 1/8 07/20/22 REGS	0	800	800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2252296434	0.3750 % IFFIM 0 3/8 11/06/23 EMTN	0	1'000	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2265251905	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 REGS	0	2'000	0	2'000	USD	99.76 %	1'774'912.13	0.20	a)
XS2270152098	0.5000 % LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN	0	3'100	0	3'100	USD	99.81 %	2'752'437.52	0.30	a)
XS2280635256	1.6380 % EBIUH 1.638 01/13/26	0	4'000	0	4'000	USD	101.73 %	3'619'782.40	0.40	a)
XS2281989785	1.2500 % AGRBK 1 1/4 01/19/26 EMTN	0	1'800	0	1'800	USD	100.49 %	1'609'094.09	0.18	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	0	2'500	0	2'500	USD	99.82 %	2'219'930.08	0.25	a)
XS2289129483	0.6250 % KUNTA 0 5/8 03/20/26 REGS	0	2'500	2'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	0	2'200	0	2'200	USD	99.64 %	1'950'113.51	0.22	a)
USD								356'074'344.80	39.44	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								46'076'205.06	5.10	
IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	10'477'252	0	0	10'477'252	USD	4.94	46'076'205.06	5.10	a)
USD								46'076'205.06	5.10	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Nicht kotierte Wertpapiere								22'823'636.36	2.53	
Strukturierte Produkte								22'823'636.36	2.53	
CH0473236351	ZKB TRACKER DYN LS BOND F 2025	0	2'609	0	2'609	CHF	8'748.04	22'823'636.36	2.53	a)
Diverse								22'823'636.36	2.53	
Derivative Finanzinstrumente								0.00	0.00	
Futures								0.00	0.00	
06/20	EURO-BUND FUTURE JUN20	0	250	250	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
06/20	US 10YR NOTE (CBT)JUN20	0	350	350	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/20	US ULTRA BOND CBT JUN20	0	50	50	0	USD	0.00	0.00	0.00	
09/20	EURO-BUND FUTURE SEP20	0	460	460	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/20	US 10YR NOTE (CBT)SEP20	0	510	510	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/20	EURO-BUND FUTURE DEC20	0	250	250	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
12/20	US 10YR NOTE (CBT)DEC20	0	610	610	0	USD	0.00	0.00	0.00	
03/21	EURO-BUND FUTURE MAR21	0	262	262	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
03/21	US 10YR NOTE (CBT)MAR21	0	628	528	100	USD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte										
			Wäh- rung	Kauf		Wäh- rung	Verkauf	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/JPY Verfall 23.04.2020		JPY	1'036'974'000		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	USD/CAD Verfall 23.04.2020		CAD	5'000'000		USD	3'638'859	0.00	0.00	
	CAD/USD Verfall 23.04.2020		USD	3'514'269		CAD	5'000'000	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 28.05.2020		CHF	8'428'693		GBP	7'000'000	0.00	0.00	
	USD/CAD Verfall 23.06.2020		CAD	67'900		USD	50'000	0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 25.06.2020		JPY	1'073'821'000		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	USD/CAD Verfall 25.06.2020		CAD	5'000'000		USD	3'516'076	0.00	0.00	
	GBP/NOK Verfall 25.06.2020		NOK	40'000'000		GBP	3'342'240	0.00	0.00	
	CAD/USD Verfall 25.06.2020		USD	3'702'790		CAD	5'000'000	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 30.07.2020		CHF	8'327'284		GBP	7'000'000	0.00	0.00	
	USD/CAD Verfall 20.08.2020		CAD	5'000'000		USD	3'703'413	0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 20.08.2020		JPY	1'068'307'000		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	GBP/NOK Verfall 20.08.2020		NOK	40'000'000		GBP	3'368'055	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 20.08.2020		CHF	8'277'948		GBP	7'000'000	0.00	0.00	
	NOK/GBP Verfall 20.08.2020		GBP	3'390'471		NOK	40'000'000	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 20.08.2020		GBP	7'000'000		CHF	8'366'729	0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 19.10.2020		JPY	1'055'710'000		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	USD/JPY Verfall 20.11.2020		JPY	1'052'787'000		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	JPY/USD Verfall 20.11.2020		USD	10'000'000		JPY	1'049'542'000	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 22.01.2021		EUR	8'215'050		USD	10'000'000	0.00	0.00	
	EUR/USD Verfall 22.01.2021		USD	10'000'000		EUR	8'175'111	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte								0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	12'280'133.22	1.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	817'827'357.52	90.59
Strukturierte Produkte	22'823'636.36	2.53
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	46'076'205.06	5.10
Sonstige Vermögenswerte	3'751'748.59	0.42
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	902'759'080.75	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-175'142.45	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	902'583'938.30	

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);	886'727'198.94	98.22
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

Umrechnungskurse

AUD	1 = CHF	0.68254560
CAD	1 = CHF	0.69638733
CNY	1 = CHF	0.13769193
DKK	100 = CHF	14.53119900
EUR	1 = CHF	1.08077900
GBP	1 = CHF	1.22159872
JPY	100 = CHF	0.84970600
MXN	1 = CHF	0.04398843
MYR	1 = CHF	0.22006184
NOK	100 = CHF	10.40109000
NZD	1 = CHF	0.64113472
PLN	1 = CHF	0.23918158
SEK	100 = CHF	10.67876700
SGD	1 = CHF	0.67033381
THB	100 = CHF	2.97226900
USD	1 = CHF	0.88960000
ZAR	1 = CHF	0.05909982

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	9'840'969.61	1.09
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	0.00	0.00
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	0.00	0.00

* 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 %.

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes	
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung
01.02.2020 – 31.01.2021	n/a	0.00	n/a	0.00

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 0.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission 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:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK Zielfonds p.a.
AA CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.95 %	0.75 %	0.20 %	4.00 %
BA CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.58 %	0.38 %	0.20 %	4.00 %
CT CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.49 %	0.29 %	0.20 %	4.00 %
DA CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.45 %	0.35 %	0.10 %	4.00 %
GT CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.38 %	0.28 %	0.10 %	4.00 %
NT CHF	01.02.2020 - 31.01.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %	4.00 %

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association (Stand: 20. April 2015) herausgegeben wurden, ermittelt.

Ausschüttung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 17.05.2021

Zahlbar: 20.05.2021

			Ausschüttung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil			
			in der Schweiz		im Ausland	
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto je Anteil
AA CHF	Ja	CHF	0.60	0.21	0.39	0.60
BA CHF	Ja	CHF	1.20	0.42	0.78	1.20
DA CHF	Ja	CHF	1.20	0.42	0.78	1.20

Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 17.05.2021

Zahlbar: 20.05.2021

			Thesaurierung für Anteilscheininhaber mit Domizil				
			in der Schweiz			im Ausland	
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto- Thesaurierung je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungssteuer	Netto- Thesaurierung je Anteil	Netto- Thesaurierung je Anteil	Barauszahlung je Anteil
CT CHF	Ja	CHF	1.349	0.472	0.877	0.877	0.472
GT CHF	Ja	CHF	1.586	0.555	1.031	1.300	0.555
NT CHF	Ja	CHF	2.055	0.719	1.336	1.336	0.719

Erklärung der Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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

Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert des Anlagefonds und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung 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 Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.01 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 zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 5.2.2) näher definierten Periode.

In ausserordentlichen Situationen kann 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 FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erst-mals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe 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;

Jahresbericht per 31.01.2021
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate
Valorennummer Klasse AA CHF: 277 967 Valorennummer Klasse GT CHF: 20 594 562
Valorennummer Klasse BA CHF: 42 725 059 Valorennummer Klasse NT CHF: 21 580 119
Valorennummer Klasse CT CHF: 44 168 701
Valorennummer Klasse DA CHF: 2 561 683 Rechnungswährung: CHF

- 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.

Pflichtpublikationen

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Global Aggregate

vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art "Effektenfonds"

(nachfolgend der "Anlagefonds")

Einstellung der Ausgabe von Anteilen und Aufschub der Rückzahlungen

Die Anleger des Anlagefonds werden informiert, dass für die Durchführung des Wechsels der Depotbank des Anlagefonds von bisher Banque Cantonale Vaudoise zu neu Zürcher Kantonalbank für die an den nachfolgend angegebenen Daten platzierten Aufträge (Auftragstag) die Ausgabe von Anteilen des Anlagefonds eingestellt bzw. die Rückzahlung von Anteilen des Anlagefonds aufgeschoben wird:

06. und 07. Februar 2020

Der Wechsel der Depotbank von der Banque Cantonale Vaudoise zur Zürcher Kantonalbank findet per 10. Februar 2020 statt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht des Anlagefonds sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der bisherigen sowie neuen Depotbank bezogen werden.

Zürich und Lausanne, 30. Januar 2020

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

Die Depotbanken:

Banque Cantonale Vaudoise (bisher)

Lausanne

Zürcher Kantonalbank (neu)

Zürich

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Global Aggregate

(neu: Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate)

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, den Fondsvertrag des Anlagefonds unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA zu ändern.

Die geplanten Änderungen des Fondsvertrags haben insbesondere eine Ergänzung der Bestimmungen der Anlagepolitik (Berücksichtigung einer Nachhaltigkeitspolitik) zum Ziel (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung). Entsprechend wird die Bezeichnung des Anlagefonds geändert (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Abschliessend wird die Bestimmung betreffend den Bewertungs-Nettoinventarwert im Zusammenhang mit der Anwendung der "Swinging Single Pricing"-Methode ergänzt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

1. Ergänzung Anlagepolitik um Nachhaltigkeitspolitik Responsible

Die Anlagepolitik des Anlagefonds wird um die Bestimmung ergänzt, dass der Vermögensverwalter bei der Auswahl von Anlagen neu zusätzlich Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance) systematisch berücksichtigt.

Der Wortlaut der zusätzlichen Bestimmung lautet wie folgt, vgl. § 8 Ziff. 2 lit. d des angepassten Fondsvertrags:

*"Bei der Auswahl von Anlagen werden vom Vermögensverwalter Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance) systematisch berücksichtigt.
 Der Vermögensverwalter stützt sich dabei auf Daten von Drittanbietern sowie auf eigene Analysen.
 Die Berücksichtigung von ESG-Kriterien beinhaltet auch die Festlegung von Ausschlüssen.
 Zudem richtet der Vermögensverwalter die Anlagetätigkeit auf eine Reduktion des CO₂-Ausstosses aus.
 Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik."*

2. Neue Bezeichnung des Anlagefonds

Die Bezeichnung des Anlagefonds wird in Anlehnung an die erweiterte Anlagepolitik gemäss Ziff. 1 dieser Mitteilung wie folgt ergänzt:

Bezeichnung bisher	Bezeichnung neu
Swisscanto (CH) Bond Fund Global Aggregate	Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate

Die Bezeichnung des Anlagefonds wird in § 1 Ziff. 1 des Fondsvertrags angepasst.

3. Erweiterung Bestimmungen Swinging Single Pricing

Die Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (Geld/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die dem Anlagefonds im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen, werden gemäss der "Swinging Single Pricing"-Methode (vgl. § 16 Ziff. 7 des Fondsvertrages) berücksichtigt.

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.

Neu kann die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes in ausserordentlichen Situationen vorübergehend überschritten werden. Daher wird § 16 Ziff. 7 wie folgt ergänzt:

"In ausserordentlichen Situationen kann 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 FINMA mitgeteilt."

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

Jahresbericht per 31.01.2021
Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate
Valorennummer Klasse AA CHF: 277 967 Valorennummer Klasse GT CHF: 20 594 562
Valorennummer Klasse BA CHF: 42 725 059 Valorennummer Klasse NT CHF: 21 580 119
Valorennummer Klasse CT CHF: 44 168 701
Valorennummer Klasse DA CHF: 2 561 683 Rechnungswährung: CHF

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

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

Zürich, 14. August 2020

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank

Zürich

Bericht der Prüfgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegende Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate bestehend aus der Vermögensrechnung und der Erfolgsrechnung, 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) für das am 31. Januar 2021 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Prospekt mit integriertem Fondsvertrag verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnung, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern ist. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnung abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnung frei von wesentlichen falschen Angaben ist.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in der Jahresrechnung enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in der Jahresrechnung als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnung von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnung. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entspricht die Jahresrechnung für das am 31. Januar 2021 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Prospekt mit integriertem Fondsvertrag.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 28. Mai 2021