

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art «Effektenfonds»

Halbjahresbericht per 31. Juli 2021

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	18
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung.....	18
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
Pauschale Verwaltungskommission	19
Benchmark.....	19
TER.....	19
Erklärung der Fussnoten	19
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 27.09.2021

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	01.02.2021	01.02.2020	01.02.2019	01.02.2018
	bis	31.07.2021	31.01.2021	31.01.2020	31.01.2019
Konsolidiert		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		935'799'183.28	902'583'938.30	939'625'725.52	918'733'179.72
Klasse AA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		165'656'555.18	182'335'646.47	216'469'674.66	258'687'247.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'199'046.776	2'407'440.233	2'759'105.170	3'387'110.152
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		75.33	75.74	78.46	76.37
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		75.38	75.84	78.42	76.33
Ausschüttung je Anteil		-	0.60	1.00	1.00
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.96 %	0.96 %	0.96 %	0.97 %
Klasse BA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		603'062.79	810'037.39	862'660.17	581'998.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'017.958	8'022.298	8'256.233	5'728.233
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		100.21	100.97	104.49	101.60
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		100.27	101.10	104.43	101.54
Ausschüttung je Anteil		-	1.20	1.60	1.60
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.59 %	0.59 %	0.59 %	0.60 %
Klasse CT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'227'835.10	4'156'655.43	3'844'224.98	3'627'017.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		40'228.644	39'566.894	35'746.444	35'191.651
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		105.10	105.05	107.54	103.06
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		105.16	105.19	107.49	103.00
Thesaurierung je Anteil		-	1.34	1.73	0.55
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.51 %
Klasse DA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'494'987.25	20'938'776.15	29'110'161.56	30'371'145.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		237'212.203	240'212.203	323'073.100	346'234.516
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.40	87.17	90.10	87.72
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		86.45	87.28	90.06	87.67
Ausschüttung je Anteil		-	1.20	1.40	1.60
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.46 %	0.46 %	0.46 %	0.47 %
Klasse GT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		65'951'070.72	58'761'597.31	59'326'766.95	53'485'801.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		579'516.618	516'627.618	509'888.889	477'831.835
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		113.80	113.74	116.35	111.93
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		113.87	113.89	116.29	111.87
Thesaurierung je Anteil		-	1.58	2.00	2.21
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.39 %	0.39 %	0.39 %	0.38 %
Klasse NT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		678'865'672.24	635'581'225.55	630'012'237.20	571'979'969.92
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'851'657.757	5'484'630.170	5'327'608.971	5'040'859.971
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		116.01	115.88	118.25	113.47
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		116.08	116.03	118.20	113.40
Thesaurierung je Anteil		-	2.05	2.47	2.64
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.01 %	0.01 %	0.01 %	0.02 %

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

Performance	YTD /31.07.2021	2020	2019	2018
Klasse AA CHF	-0.13 %	-0.73 %	5.35 %	-1.07 %
Klasse BA CHF (Lancierung 06.08.2018)	0.08 %	-0.37 %	5.74 %	-0.71 %
Klasse CT CHF (Lancierung 23.10.2018)	0.13 %	-0.28 %	5.84 %	0.71 %
Klasse DA CHF	0.10 %	-0.25 %	5.88 %	-0.62 %
Klasse GT CHF	0.14 %	-0.17 %	5.95 %	-0.54 %
Klasse NT CHF	0.35 %	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)

	31.07.2021	31.01.2021
Bankguthaben auf Sicht	12'121'126.34	12'280'133.22
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	850'916'511.37	817'827'357.52
Strukturierte Produkte	22'527'593.13	22'823'636.36
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	46'129'301.69	46'076'205.06
Derivative Finanzinstrumente	-70'844.34	0.00
Sonstige Vermögenswerte	4'340'866.55	3'751'748.59
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	935'964'554.74	902'759'080.75
Andere Verbindlichkeiten	-165'371.46	-175'142.45
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	935'799'183.28	902'583'938.30

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF

von 01.02.2021 01.02.2020

bis 31.07.2021 31.01.2021

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	2'407'440.233	2'759'105.170
Ausgegebene Anteile	4'198.186	4'704.118
Zurückgenommene Anteile	-212'591.643	-356'369.055
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	2'199'046.776	2'407'440.233

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse BA CHF

von 01.02.2021 01.02.2020

bis 31.07.2021 31.01.2021

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	8'022.298	8'256.233
Zurückgenommene Anteile	-2'004.340	-233.935
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	6'017.958	8'022.298

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse CT CHF

von 01.02.2021 01.02.2020

bis 31.07.2021 31.01.2021

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	39'566.894	35'746.444
Ausgegebene Anteile	4'588.957	6'193.172
Zurückgenommene Anteile	-3'927.207	-2'372.722
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	40'228.644	39'566.894

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DA CHF

von 01.02.2021 01.02.2020

bis 31.07.2021 31.01.2021

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	240'212.203	323'073.100
Ausgegebene Anteile	0.000	10'700.000
Zurückgenommene Anteile	-3'000.000	-93'560.897
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	237'212.203	240'212.203

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse GT CHF

von 01.02.2021 01.02.2020

bis 31.07.2021 31.01.2021

Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	516'627.618	509'888.889
Ausgegebene Anteile	75'064.000	60'526.406
Zurückgenommene Anteile	-12'175.000	-53'787.677
Bestand am Ende der Rechnungsperiode	579'516.618	516'627.618

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.02.2021	01.02.2020
		bis	31.07.2021	31.01.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			5'484'630.170	5'327'608.971
Ausgegebene Anteile			367'027.587	378'487.000
Zurückgenommene Anteile			0.000	-221'465.801
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			5'851'657.757	5'484'630.170

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.02.2021	01.02.2020
		bis	31.07.2021	31.01.2021
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			902'583'938.30	939'625'725.52
Ausbezahlte Ausschüttung			-1'669'268.54	-3'012'868.53
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-4'285'356.61	-4'828'689.26
Saldo aus dem Anteilverkehr			33'530'563.13	-16'203'985.69
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			5'639'307.00	-12'996'243.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			935'799'183.28	902'583'938.30

Erfolgsrechnung	(konsolidiert)	von	01.02.2021	01.02.2020
		bis	31.07.2021	31.01.2021
Ertrag				
Erträge der Bankguthaben auf Sicht			0.00	8'273.75
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-21'537.06	-55'387.40
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			6'897'725.49	14'554'454.20
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen			523'547.44	1'128'287.93
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			312'142.17	779'613.78
Total Ertrag			7'711'878.04	16'415'242.26
Aufwand				
Passivzinsen			1'255.02	-17'385.14
Reglementarische Vergütungen			-1'002'550.09	-2'218'723.69
Sonstige Aufwendungen			-36.35	1'689.80
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-44'700.01	-264'082.54
Total Aufwand			-1'046'031.43	-2'498'501.57
Nettoertrag / Verlust			6'665'846.61	13'916'740.69
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-3'487'595.26	3'318'784.62
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)			52'109.76	134'825.79
Realisierter Erfolg			3'230'361.11	17'370'351.10
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			2'408'945.89	-30'366'594.42
Gesamterfolg			5'639'307.00	-12'996'243.74

Inventar des Fondsvermogens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveranderungen wahrend der Periode

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Borse kotiert sind								897'045'813.06	95.84	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								850'916'511.37	90.91	
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	0	1'500	0	1'500	AUD	93.37 %	932'992.56	0.10	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	3'000	0	3'000	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	1'500	500	0	2'000	AUD	135.41 %	1'804'150.68	0.19	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	600	0	0	600	AUD	119.59 %	477'995.81	0.05	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	2'300	0	500	1'800	AUD	110.20 %	1'321'474.32	0.14	a)
AU3CB0247393	3.7500 % SGSPAA 3 3/4 09/27/24 MTN	400	0	400	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	2'000	0	0	2'000	AUD	118.64 %	1'580'648.69	0.17	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	400	0	0	400	AUD	105.02 %	279'844.47	0.03	a)
AU3CB0266013	2.4000 % VW 2.4 08/28/24 MTN	600	0	0	600	AUD	104.06 %	415'929.54	0.04	a)
AU3CB0273357	0.5150 % AUSTC 0.515 01/29/24 MTN	700	0	700	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3CB0274280	5.2500 % QANAU 5 1/4 09/09/30 MTN	1'400	0	1'400	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU3SG0001837	3.0000 % SAFA 3 05/24/28 28	3'000	0	1'000	2'000	AUD	112.87 %	1'503'798.65	0.16	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'700	0	0	1'700	AUD	98.79 %	1'118'739.03	0.12	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	0	3'000	0	3'000	AUD	98.48 %	1'968'149.84	0.21	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	0	3'000	0	3'000	AUD	101.52 %	2'028'925.06	0.22	a)
AUD								13'432'648.65	1.44	
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	9'000	0	2'500	6'500	CAD	130.76 %	6'170'408.55	0.66	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	1'750	0	0	1'750	CAD	105.45 %	1'339'789.97	0.14	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	1'500	0	0	1'500	CAD	122.16 %	1'330'275.76	0.14	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	4'500	0	0	4'500	CAD	93.82 %	3'064'961.63	0.33	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	2'000	1'000	0	3'000	CAD	140.51 %	3'060'235.38	0.33	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	2'000	0	0	2'000	CAD	104.16 %	1'512'457.78	0.16	a)
CA459058HS51	1.9000 % IBRD 1.9 01/16/25 GDIF	2'000	0	0	2'000	CAD	103.56 %	1'503'716.76	0.16	a)
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	0	500	0	500	CAD	101.57 %	368'694.62	0.04	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	0	2'700	0	2'700	CAD	99.50 %	1'950'316.08	0.21	a)
US052591AT11	5.0000 % AUST 5 12/20/24 EMTN	3'335	0	1'635	1'700	CAD	113.71 %	1'403'356.20	0.15	a)
US00769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	0	2'000	500	1'500	CAD	98.92 %	1'077'268.98	0.12	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	4'000	0	0	4'000	CAD	98.07 %	2'848'004.29	0.30	a)
CAD								25'629'486.00	2.74	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	3'000	0	0	3'000	CHF	123.28 %	3'698'400.00	0.40	a)
CHF								3'698'400.00	0.40	
CND100008S93	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	0	20'000	0	20'000	CNY	102.93 %	2'889'609.49	0.31	a)
CND10000H9K9	3.5200 % CGB 3.52 05/04/27 1710	0	30'000	0	30'000	CNY	104.47 %	4'399'608.38	0.47	a)
CND10000HWW0	3.5900 % CGB 3.59 08/03/27 1718	0	30'000	0	30'000	CNY	104.81 %	4'413'783.40	0.47	a)
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	0	30'000	0	30'000	CNY	105.10 %	4'426'134.95	0.47	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	0	50'000	0	50'000	CNY	103.02 %	7'230'740.66	0.77	a)
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	0	10'000	0	10'000	CNY	101.26 %	1'421'432.39	0.15	a)
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	0	30'000	0	30'000	CNY	102.77 %	4'327'912.09	0.46	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	0	20'000	0	20'000	CNY	103.00 %	2'891'658.96	0.31	a)
CND10002LTC8	2.2400 % CGB 2.24 03/05/23 INBK	0	20'000	0	20'000	CNY	99.82 %	2'802'327.43	0.30	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	0	40'000	0	40'000	CNY	97.98 %	5'501'333.59	0.59	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/71 INBK	0	20'000	0	20'000	CNY	104.88 %	2'944'439.78	0.31	a)
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	29'000	0	0	29'000	CNY	99.82 %	4'063'533.53	0.43	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	0	10'000	0	10'000	CNY	100.39 %	1'409'261.92	0.15	a)
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	0	23'000	0	23'000	CNY	100.57 %	3'247'146.20	0.35	a)
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	0	30'000	0	30'000	CNY	100.00 %	4'211'193.49	0.45	a)
XS2358798598	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 JUN	0	20'000	0	20'000	CNY	100.50 %	2'821'612.08	0.30	a)
XS2366200850	2.5500 % IBRD 2.55 07/19/23	0	15'000	0	15'000	CNY	99.75 %	2'100'437.98	0.22	a)
CNY								61'102'166.32	6.53	
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	4'500	0	0	4'500	DKK	125.33 %	814'863.81	0.09	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	3'000	0	0	3'000	DKK	181.31 %	785'849.61	0.08	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'000	0	0	8'000	DKK	110.10 %	1'272'567.77	0.14	a)
DKK								2'873'281.19	0.31	
AT0000A2GH08	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/13/27 EMTN	700	0	0	700	EUR	105.43 %	793'097.13	0.08	a)
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	800	0	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	3'000	0	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/71 93	0	600	600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0974365976	0.3750 % KBCBB 0 3/8 06/16/27 EMTN	1'600	0	1'600	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	1'600	0	0	1'600	EUR	103.50 %	1'779'710.08	0.19	a)
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	3'200	0	3'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 EMTN	0	3'000	0	3'000	EUR	101.50 %	3'272'442.53	0.35	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	4'200	2'800	0	7'000	EUR	105.63 %	7'946'694.12	0.85	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	7'000	0	1'000	6'000	EUR	103.57 %	6'678'297.54	0.71	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	0	3'000	0	3'000	EUR	100.43 %	3'237'848.14	0.35	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	1'700	0	500	1'200	EUR	109.62 %	1'413'669.38	0.15	a)
DE000A28RSR6	0.5000 % ALVGR 0 1/2 01/14/31 EMTN	2'200	0	700	1'500	EUR	104.13 %	1'678'682.42	0.18	a)
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	2'000	0	0	2'000	EUR	112.81 %	2'424'788.57	0.26	a)
DE000A2SBDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	1'000	0	0	1'000	EUR	103.73 %	1'114'779.85	0.12	a)
DE000A3E5MH6	0.6250 % ANNGR 0 5/8 12/14/29 EMTN	0	1'200	0	1'200	EUR	102.43 %	1'321'009.28	0.14	a)
DE000A3HZZF6	0.0000 % KFW 0 01/10/31 EMTN	1'900	0	1'900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE000A3KNP96	0.7500 % TRAGR 0 3/4 03/24/29 EMTN	0	1'000	0	1'000	EUR	102.85 %	1'105'311.80	0.12	a)
DE000DL19VT2	0.7500 % DB 0 3/4 02/17/27 EMTN	0	1'400	400	1'000	EUR	101.42 %	1'089'900.69	0.12	a)
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	0	675	0	675	EUR	102.70 %	744'975.57	0.08	a)
DE000NWB0AL1	0.0000 % NRWK 0 02/03/31 EMTN	3'000	0	0	3'000	EUR	101.06 %	3'258'256.57	0.35	a)
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	0	1'300	0	1'300	EUR	100.95 %	1'410'360.54	0.15	a)
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	5'000	0	1'000	4'000	EUR	107.90 %	4'638'206.36	0.50	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	1'000	0	0	1'000	EUR	103.72 %	1'114'629.39	0.12	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	3'000	0	1'500	1'500	EUR	105.71 %	1'704'136.54	0.18	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	2'800	0	800	2'000	EUR	101.42 %	2'179'822.87	0.23	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	3'650	0	650	3'000	EUR	99.01 %	3'192'195.15	0.34	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/71	0	2'000	0	2'000	EUR	94.51 %	2'031'429.15	0.22	a)
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	0	3'100	0	3'100	EUR	101.15 %	3'369'863.52	0.36	a)
ES0413900574	0.1250 % SANTAN 0 1/8 06/04/30	3'000	0	1'000	2'000	EUR	102.22 %	2'197'082.45	0.23	a)
EU000A287074	0.0000 % EU 0 06/02/28 EMTN	1'700	0	1'700	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 EMTN	0	1'550	1'550	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
EU000A3KSXE1	0.0000 % EU 0 07/04/31 EMTN	0	1'000	700	300	EUR	102.13 %	329'259.30	0.04	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 EMTN	0	1'600	0	1'600	EUR	103.50 %	1'779'675.69	0.19	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	0	1'800	1'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0012173862	2.1250 % RIFP 2 1/8 09/27/24	1'600	0	0	1'600	EUR	107.17 %	1'842'730.12	0.20	a)
FR0013424868	0.6250 % VIVFP 0 5/8 06/11/25 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013424876	1.1250 % VIVFP 1 1/8 12/11/28 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	100.90 %	2'168'667.55	0.23	a)
FR0013479276	0.7500 % SOCGEN 0 3/4 01/25/27	2'000	0	0	2'000	EUR	102.44 %	2'201'854.09	0.24	a)
FR0013509726	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 04/28/25	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013516077	0.5000 % EFPF 0 1/2 06/05/28 EMTN	1'700	0	0	1'700	EUR	104.20 %	1'903'676.00	0.20	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013534559	0.0000 % CADES 0 11/25/30	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	1'800	0	0	1'800	EUR	101.23 %	1'958'261.85	0.21	a)
FR0014000774	0.7500 % LAMON 0 3/4 04/20/26	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014000MX1	0.0000 % SFILFR 0 11/23/28 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014000OZ2	1.0000 % SOCGEN 1 11/24/30 EMTN	1'000	0	0	1'000	EUR	100.70 %	1'082'173.75	0.12	a)
FR0014001S17	0.0000 % CADES 0 05/25/31 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014001ZY9	0.1000 % UNEDIC 0.1 05/25/34 EMTN	0	1'200	1'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014002GB5	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 05/25/36 EMTN	0	2'200	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014003067	0.0000 % IDF 0 04/20/28 EMTN	0	1'200	200	1'000	EUR	101.67 %	1'092'673.40	0.12	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014003C70	0.0000 % OSEOFI 0 05/25/28 EMTN	0	2'000	0	2'000	EUR	101.99 %	2'192'246.33	0.23	a)
FR0014003OC5	0.4000 % STIFFP 0.4 05/28/31 EMTN	0	3'500	1'000	2'500	EUR	103.11 %	2'770'345.60	0.30	a)
FR0014004FR9	0.5000 % DGFP 0 1/2 01/09/32 EMTN	0	1'500	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	0	1'625	0	1'625	EUR	100.91 %	1'762'199.73	0.19	a)
HK0000659794	0.0000 % CHINA 0 11/25/25	3'000	0	1'600	1'400	EUR	100.60 %	1'513'553.57	0.16	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27	3'000	0	0	3'000	EUR	104.32 %	3'363'200.42	0.36	a)
IT0005415416	0.6500 % BTPS 0.65 05/15/26 CPI	5'000	0	3'600	1'400	EUR	110.93 %	1'669'087.64	0.18	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24	2'400	0	1'100	1'300	EUR	100.79 %	1'408'194.89	0.15	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51	500	0	500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37	2'700	0	0	2'700	EUR	97.83 %	2'838'561.79	0.30	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31	0	1'000	0	1'000	EUR	99.76 %	1'072'071.52	0.11	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26	0	4'000	3'500	500	EUR	100.22 %	538'502.18	0.06	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45	0	1'700	0	1'700	EUR	101.10 %	1'846'984.83	0.20	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31	0	3'800	0	3'800	EUR	102.82 %	4'198'796.32	0.45	a)
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26	0	3'500	0	3'500	EUR	99.94 %	3'759'208.95	0.40	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	0	3'000	3'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	0	2'200	2'200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	4'000	0	1'000	3'000	EUR	105.87 %	3'413'399.36	0.36	a)
SI0002104121	0.6875 % SLOREP 0.6875 03/03/81	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1107727007	2.1250 % C 2 1/8 09/10/26 EMTN	1'300	0	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	1'000	0	0	1'000	EUR	113.05 %	1'214'909.07	0.13	a)
XS1419646317	1.5000 % BNP 1 1/2 05/25/28 EMTN	2'000	0	0	2'000	EUR	110.62 %	2'377'631.00	0.25	a)
XS1681520786	1.7500 % TCLAU 1 3/4 03/29/28 EMTN	1'200	0	0	1'200	EUR	109.08 %	1'406'756.95	0.15	a)
XS1823518730	1.0000 % WURTH 1 05/26/25 EMTN	1'200	0	0	1'200	EUR	104.89 %	1'352'643.97	0.14	a)
XS1843436228	1.5000 % FIS 1 1/2 05/21/27	1'200	0	1'200	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	105.64 %	1'248'813.51	0.13	a)
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	2'000	0	0	2'000	EUR	106.78 %	2'295'051.53	0.25	a)
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	2'000	0	1'000	1'000	EUR	113.58 %	1'220'604.94	0.13	a)
XS2018637327	1.1250 % HEIGR 1 1/8 12/01/27 EMTN	1'250	0	0	1'250	EUR	106.25 %	1'427'300.80	0.15	a)
XS2043678841	0.1250 % GS 0 1/8 08/19/24 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	1'500	0	0	1'500	EUR	101.53 %	1'636'640.40	0.17	a)
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	1'550	0	0	1'550	EUR	102.56 %	1'708'469.17	0.18	a)
XS2056374353	0.8750 % MDLZ 0 7/8 10/01/31 REGS	2'000	0	0	2'000	EUR	104.29 %	2'241'574.77	0.24	a)
XS2057070182	1.5000 % CKHGTH 1 1/2 10/17/31	2'000	0	0	2'000	EUR	106.85 %	2'296'663.57	0.25	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	2'400	0	800	1'600	EUR	105.06 %	1'806'586.02	0.19	a)
XS2076155105	0.3750 % ABT 0 3/8 11/19/27	1'000	0	1'000	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	103.33 %	1'388'114.77	0.15	a)
XS2089226026	1.7500 % DT 1 3/4 12/09/49 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2089368596	0.7500 % ISPIM 0 3/4 12/04/24 EMTN	1'400	0	400	1'000	EUR	102.97 %	1'106'612.17	0.12	a)
XS2100788780	0.4500 % GIS 0.45 01/15/26	1'150	0	0	1'150	EUR	102.50 %	1'266'758.20	0.14	a)
XS2101357072	0.7500 % FREGR 0 3/4 01/15/28 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2102932055	0.5000 % MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN	1'800	0	0	1'800	EUR	103.66 %	2'005'210.92	0.21	a)
XS2104915033	0.1900 % NGGLN 0.19 01/20/25	1'200	0	0	1'200	EUR	101.22 %	1'305'353.14	0.14	a)
XS2107315470	0.6250 % ENIIM 0 5/8 01/23/30 EMTN	1'500	0	1'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	2'400	0	0	2'400	EUR	101.27 %	2'611'970.13	0.28	a)
XS2126161764	0.5000 % RELLN 0 1/2 03/10/28	1'000	0	0	1'000	EUR	102.76 %	1'104'376.81	0.12	a)
XS2126169742	1.0000 % GIVNVX 1 04/22/27	300	0	300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2160861808	0.0100 % IBRD 0.01 04/24/28 GDIF	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	2'150	0	0	2'150	EUR	105.13 %	2'429'101.85	0.26	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2176686546	0.4500 % CS 0.45 05/19/25 EMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2177013765	0.7500 % RKTLLN 0 3/4 05/19/30 REGS	1'350	0	0	1'350	EUR	104.89 %	1'521'709.96	0.16	a)
XS2177580508	0.8750 % EOANGR 0 7/8 08/20/31 EMTN	1'400	0	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2178585423	2.1250 % CONGR 2 1/8 11/27/23 EMTN	900	0	0	900	EUR	105.12 %	1'016'726.94	0.11	a)
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	1'500	0	500	1'000	EUR	108.78 %	1'169'094.87	0.12	a)
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	1'000	0	0	1'000	EUR	107.77 %	1'158'197.48	0.12	a)
XS2193666042	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 06/23/29 EMTN	1'000	0	0	1'000	EUR	103.48 %	1'112'125.35	0.12	a)
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	EUR	105.48 %	1'133'576.24	0.12	a)
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	1'700	0	0	1'700	EUR	105.39 %	1'925'490.14	0.21	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	1'100	0	0	1'100	EUR	110.52 %	1'306'503.07	0.14	a)
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	2'200	0	700	1'500	EUR	106.91 %	1'723'464.91	0.18	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/80	1'300	0	0	1'300	EUR	103.75 %	1'449'535.14	0.15	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	1'700	0	700	1'000	EUR	105.65 %	1'135'392.47	0.12	a)
XS2225207468	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 03/03/27 EMTN	2'000	0	0	2'000	EUR	104.79 %	2'252'364.70	0.24	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	1'500	0	0	1'500	EUR	100.74 %	1'623'953.64	0.17	a)
XS2231330965	0.3750 % JCI 0 3/8 09/15/27	2'100	0	0	2'100	EUR	101.58 %	2'292'560.39	0.24	a)
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	1'300	0	0	1'300	EUR	101.58 %	1'419'176.11	0.15	a)
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	0	1'800	0	1'800	EUR	100.70 %	1'947'951.24	0.21	a)
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	2'600	0	1'100	1'500	EUR	99.50 %	1'603'980.45	0.17	a)
XS2235996217	0.0000 % NOVNVX 0 09/23/28	2'450	0	450	2'000	EUR	100.36 %	2'157'168.32	0.23	a)
XS2237901355	0.3750 % TRNIM 0 3/8 09/25/30 EMTN	1'000	0	0	1'000	EUR	100.47 %	1'079'777.07	0.12	a)
XS2238342484	2.1250 % CTPNV 2 1/8 10/01/25 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2242633258	0.4000 % PEP 0.4 10/09/32	1'450	0	0	1'450	EUR	101.31 %	1'578'735.36	0.17	a)
XS2242747348	0.5410 % ASABRE 0.541 10/23/28	750	0	750	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	800	0	800	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	1'200	0	0	1'200	EUR	103.72 %	1'337'542.37	0.14	a)
XS2250201329	0.0000 % Q 0 10/29/30 EMTN	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2251371022	0.0000 % EIB 0 03/28/28 EARN	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2261215011	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 04/23/31	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	1'400	0	0	1'400	EUR	97.76 %	1'470'898.97	0.16	a)
XS2262263622	0.0100 % ONT 0.01 11/25/30 EMTN	2'000	0	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2270142966	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 12/08/50 EMTN	1'300	0	1'300	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	1'600	0	0	1'600	EUR	98.74 %	1'697'878.60	0.18	a)
XS2282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	2'900	0	900	2'000	EUR	100.98 %	2'170'516.02	0.23	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	1'100	0	0	1'100	EUR	99.00 %	1'170'317.87	0.13	a)
XS2286044370	0.0000 % ABBNVX 0 01/19/30 EMTN	1'300	0	0	1'300	EUR	98.88 %	1'381'496.27	0.15	a)
XS2287624584	0.1250 % MOTOPOG 0 1/8 07/20/28 EMTN	1'100	0	0	1'100	EUR	100.65 %	1'189'811.86	0.13	a)
XS2287744135	0.2500 % CPPIBC 0 1/4 01/18/41 EMTN	1'400	0	1'400	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2287879733	0.0100 % EIB 0.01 05/15/41 EMTN	2'850	0	2'850	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2288097483	1.3500 % WIZZLN 1.35 01/19/24 EMTN	600	0	0	600	EUR	102.23 %	659'163.42	0.07	a)
XS2289133758	0.8500 % UCGIM 0.85 01/19/31 EMTN	2'500	0	800	1'700	EUR	100.43 %	1'834'798.70	0.20	a)
XS2289410420	0.2000 % IBRD 0.2 01/21/61	2'000	0	700	1'300	EUR	91.04 %	1'271'851.72	0.14	a)
XS2289587789	1.4500 % MEX 1.45 10/25/33	900	0	900	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	2'450	0	1'450	1'000	EUR	100.82 %	1'083'516.90	0.12	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	1'700	0	1'000	700	EUR	101.76 %	765'525.87	0.08	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	2'500	0	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	0	1'800	0	1'800	EUR	99.70 %	1'928'548.72	0.21	a)
XS2295335413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	0	1'100	0	1'100	EUR	101.77 %	1'203'122.90	0.13	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	3'100	0	3'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2300313041	0.1250 % FABUH 0 1/8 02/16/26 EMTN	0	2'250	2'250	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2303052695	0.7500 % CTPNV 0 3/4 02/18/27 EMTN	0	1'850	0	1'850	EUR	100.38 %	1'995'698.81	0.21	a)
XS2305244241	0.2500 % LPTY 0 1/4 02/23/26 EMTN	0	1'900	0	1'900	EUR	100.47 %	2'051'515.38	0.22	a)
XS2317123052	0.0000 % LATVIA 0 03/17/31 GMTN	0	3'450	3'450	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2323295563	0.0460 % NIDEC 0.046 03/30/26	0	1'050	0	1'050	EUR	100.79 %	1'137'343.04	0.12	a)
XS2325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	0	1'650	0	1'650	EUR	102.37 %	1'815'217.42	0.19	a)
XS2328981431	0.3360 % ASABRE 0.336 04/19/27	0	600	0	600	EUR	101.57 %	654'914.08	0.07	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2332234413	0.1250 % SGSNVX 0 1/8 04/21/27 EMTN	0	2'000	0	2'000	EUR	100.87 %	2'168'065.72	0.23	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	0	1'600	0	1'600	EUR	101.89 %	1'752'008.77	0.19	a)
XS2338991941	0.2500 % Q 0 1/4 05/05/31 EMTN	0	2'100	2'100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2339399946	1.2500 % ANDRRA 1 1/4 05/06/31 EMTN	0	2'500	2'500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	0	2'700	700	2'000	EUR	100.84 %	2'167'420.90	0.23	a)
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	0	2'500	500	2'000	EUR	101.30 %	2'177'394.06	0.23	a)
XS2343540519	0.5000 % REESM 0 1/2 05/24/33 EMTN	0	2'100	0	2'100	EUR	102.30 %	2'308'764.63	0.25	a)
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	0	2'400	900	1'500	EUR	103.07 %	1'661'465.82	0.18	a)
XS2344385815	0.8750 % RYAUD 0 7/8 05/25/26 EMTN	0	1'000	0	1'000	EUR	101.94 %	1'095'521.34	0.12	a)
XS2346986990	0.1250 % SBAB 0 1/8 08/27/26 EMTN	0	2'000	2'000	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
XS2347663507	0.3750 % AZN 0 3/8 06/03/29 EMTN	0	1'800	0	1'800	EUR	101.81 %	1'969'404.28	0.21	a)
XS2348030425	0.1250 % NOVOB 0 1/8 06/04/28 EMTN	0	1'200	0	1'200	EUR	101.59 %	1'310'137.68	0.14	a)
XS2353473692	1.3750 % RBAIV 1 3/8 06/17/33	0	800	0	800	EUR	101.04 %	868'687.87	0.09	a)
XS2353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	0	2'350	1'350	1'000	EUR	101.02 %	1'085'601.91	0.12	a)
XS2356033147	0.0000 % ICO 0 04/30/27 EMTN	0	1'500	0	1'500	EUR	101.48 %	1'635'963.34	0.17	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	0	1'800	0	1'800	EUR	101.37 %	1'960'970.08	0.21	a)
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	0	1'500	0	1'500	EUR	106.69 %	1'719'821.69	0.18	a)
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	0	1'800	0	1'800	EUR	102.01 %	1'973'273.17	0.21	a)
XS2361047538	0.5000 % BGOSK 0 1/2 07/08/31 EMTN	0	4'000	0	4'000	EUR	100.48 %	4'319'495.18	0.46	a)
XS2361416915	0.0000 % LATVIA 0 01/24/29 GMTN	0	1'000	0	1'000	EUR	101.00 %	1'085'440.71	0.12	a)
XS2362968906	0.1000 % WSTP 0.1 07/13/27	0	1'500	0	1'500	EUR	100.51 %	1'620'213.86	0.17	a)
XS2363910436	2.2500 % MEX 2 1/4 08/12/36	0	2'800	1'000	1'800	EUR	99.62 %	1'927'097.88	0.21	a)
EUR								234'087'569.87	25.01	
CH0550413337	2.2500 % CS 2 1/4 06/09/28 EMTN	650	0	650	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
DE000LB2CQX3	1.5000 % LBBW 1 1/2 02/03/25	1'000	0	300	700	GBP	102.07 %	900'292.78	0.10	a)
FR0013480027	1.2500 % BFCM 1 1/4 12/05/25	1'000	0	0	1'000	GBP	101.24 %	1'275'636.13	0.14	a)
FR0014001J59	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 12/07/27 EMTN	4'000	0	2'500	1'500	GBP	97.92 %	1'850'759.20	0.20	a)
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	0	700	0	700	GBP	101.01 %	890'960.67	0.10	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	500	0	0	500	GBP	158.43 %	998'167.79	0.11	a)
GB00BJMHBS34	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	400	0	0	400	GBP	102.89 %	518'596.14	0.06	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	0	2'340	0	2'340	GBP	102.62 %	3'025'678.85	0.32	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	1'200	0	800	400	GBP	86.93 %	438'153.00	0.05	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	6'500	700	1'800	5'400	GBP	112.59 %	7'661'074.79	0.82	a)
XS0206361221	4.7500 % UKRAIL 4 3/4 11/29/35 EMTN	1'700	0	0	1'700	GBP	148.50 %	3'180'950.24	0.34	a)
XS0295479983	4.5000 % EIB 4 1/2 03/07/44 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	167.39 %	2'109'187.82	0.23	a)
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	700	0	0	700	GBP	119.02 %	1'049'791.77	0.11	a)
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	700	0	0	700	GBP	107.38 %	947'103.28	0.10	a)
XS2014278944	2.3750 % BRK 2 3/8 06/19/39	300	0	300	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2021481663	2.3750 % MOTOFG 2 3/8 07/03/39 EMTN	950	0	0	950	GBP	110.27 %	1'320'021.61	0.14	a)
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	1'000	0	500	500	GBP	103.50 %	652'082.10	0.07	a)
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	0	300	GBP	100.38 %	379'439.85	0.04	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	101.16 %	1'274'653.27	0.14	a)
XS2170601848	1.2500 % GSK 1 1/4 10/12/28 EMTN	1'600	0	0	1'600	GBP	100.77 %	2'031'622.69	0.22	a)
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	400	0	0	400	GBP	101.94 %	513'812.90	0.05	a)
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	98.40 %	1'239'862.62	0.13	a)
XS2238341080	1.6250 % O 1 5/8 12/15/30 EMTN	500	0	0	500	GBP	100.30 %	631'920.92	0.07	a)
XS2244418609	1.0000 % ENELIM 1 10/20/27 EMTN	800	0	400	400	GBP	98.83 %	498'147.66	0.05	a)
XS2251337353	1.1250 % VZ 1 1/8 11/03/28	1'700	0	0	1'700	GBP	98.10 %	2'101'468.60	0.22	a)
XS2266989149	1.6250 % CBGLN 1 5/8 12/03/30 EMTN	1'300	0	0	1'300	GBP	100.29 %	1'642'781.59	0.18	a)
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	0	0	1'000	GBP	96.98 %	1'222'070.37	0.13	a)
XS2295280411	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 12/03/26 EMTN	1'150	0	1'150	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
XS2297626645	0.8750 % FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN	0	1'700	1'000	700	GBP	99.13 %	874'360.45	0.09	a)
XS2305547064	1.6250 % SGELN 1 5/8 02/25/31	0	600	0	600	GBP	99.40 %	751'485.58	0.08	a)
XS2332199830	2.5000 % GATAIR 2 1/2 04/15/30 EMTN	0	500	0	500	GBP	101.26 %	637'969.27	0.07	a)
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	0	1'400	600	800	GBP	100.16 %	1'009'702.61	0.11	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2347400595	1.7500 % PRSFIN 1 3/4 11/24/26 JUN	0	1'800	0	1'800	GBP	105.47 %	2'301'432.25	0.25	a)
XS2348234936	1.6670 % BAC 1.667 06/02/29 EMTN	0	1'000	0	1'000	GBP	101.35 %	1'277'123.01	0.14	a)
GBP								45'206'309.81	4.83	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN 300'000	0	0	0	300'000	JPY	99.74 %	2'470'941.64	0.26	a)
FR00140025B6	0.5940 % SOCGEN 0.594 02/25/26 EMTN	0	200'000	0	200'000	JPY	99.74 %	1'647'347.28	0.18	a)
FR0014003L79	0.5570 % BNP 0.557 05/20/27 EMTN	0	300'000	0	300'000	JPY	100.06 %	2'478'844.41	0.26	a)
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	200'000	0	200'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1120231J51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/28 23	1'200'000	0	500'000	700'000	JPY	103.69 %	5'993'956.29	0.64	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	1'700'000	0	0	1'700'000	JPY	120.63 %	16'934'616.46	1.81	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	1'000'000	300'000	0	1'300'000	JPY	101.70 %	10'917'824.06	1.17	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	0	950'000	0	950'000	JPY	103.23 %	8'098'124.09	0.87	a)
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	560'000	0	100'000	460'000	JPY	110.40 %	4'193'519.68	0.45	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	940'000	0	0	940'000	JPY	140.05 %	10'871'302.58	1.16	a)
XS0171578502	1.0500 % DBJJP 1.05 06/20/23 INTL	225'000	0	0	225'000	JPY	101.93 %	1'893'859.68	0.20	a)
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	500'000	0	100'000	400'000	JPY	109.28 %	3'609'642.73	0.39	a)
XS0257403278	2.3000 % DBJJP 2.3 03/19/26 INTL	610'000	0	70'000	540'000	JPY	110.45 %	4'925'012.48	0.53	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	0	0	100'000	JPY	115.11 %	950'537.49	0.10	a)
XS1092948618	1.0000 % GS 1 08/06/24 EMTN	140'000	0	0	140'000	JPY	100.88 %	1'166'274.08	0.12	a)
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	600'000	0	0	600'000	JPY	99.32 %	4'921'222.12	0.53	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	0	0	600'000	JPY	99.08 %	4'909'276.30	0.52	a)
XS1645683852	0.1830 % WMT 0.183 07/15/22	370'000	0	0	370'000	JPY	99.93 %	3'053'278.58	0.33	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	0	100'000	JPY	101.33 %	836'735.92	0.09	a)
XS1789478853	0.6400 % CHIEAS 0.64 03/16/21 EMTN	200'000	0	200'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
XS1833010397	0.7220 % GLW 0.722 06/06/25	500'000	0	0	500'000	JPY	98.93 %	4'084'750.45	0.44	a)
XS1876097046	0.6600 % BNP 0.66 09/07/23 EMTN	400'000	0	100'000	300'000	JPY	99.87 %	2'474'184.50	0.26	a)
XS1942687184	0.8580 % RABOBK 0.858 01/31/29 GMTN	500'000	0	0	500'000	JPY	99.41 %	4'104'651.89	0.44	a)
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	600'000	0	200'000	400'000	JPY	100.26 %	3'311'699.14	0.35	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	0	300'000	0	300'000	JPY	100.08 %	2'479'240.79	0.26	a)
JPY								106'326'842.64	11.36	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	350'000	0	0	350'000	MXN	104.66 %	1'671'720.74	0.18	a)
MXN								1'671'720.74	0.18	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	2'000	0	0	2'000	MYR	102.48 %	440'165.42	0.05	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200	MYR	104.50 %	44'884.61	0.00	a)
MYR								485'050.03	0.05	
NZGOVD0521C2	6.0000 % NZGB 6 05/15/21 0521	600	0	600	0	NZD	0.00 %	0.00	0.00	
NZD								0.00	0.00	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	3'000	0	0	3'000	PLN	131.74 %	930'370.21	0.10	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	3'000	0	0	3'000	PLN	100.13 %	707'135.03	0.08	a)
PLN								1'637'505.24	0.17	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000	SEK	151.36 %	797'148.13	0.09	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	6'200	0	0	6'200	SEK	104.16 %	680'222.25	0.07	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	5'000	0	0	5'000	SEK	106.29 %	559'810.69	0.06	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	0	0	5'000	SEK	100.19 %	527'641.83	0.06	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	10'000	0	0	10'000	SEK	100.60 %	1'059'697.14	0.11	a)
SEK								3'624'520.04	0.39	
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	400	0	0	400	SGD	104.49 %	279'740.90	0.03	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	400	0	0	400	SGD	120.75 %	323'272.21	0.03	a)
SGD								603'013.11	0.06	
TH0623033600	3.6250 % THAIGB 3 5/8 06/16/23	30'000	0	0	30'000	THB	105.77 %	874'969.97	0.09	a)
TH0623038302	5.6700 % THAIGB 5.67 03/13/28	9'000	0	0	9'000	THB	129.39 %	321'096.14	0.03	a)
THB								1'196'066.11	0.13	
BE6322164920	1.0000 % BELG 1 05/28/30 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	97.31 %	881'956.78	0.09	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US00254EMX75	1.7500 % SEK 1 3/4 12/12/23 GMTN	1'000	0	0	1'000	USD	103.24 %	935'682.25	0.10	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	3'500	0	0	3'500	USD	110.00 %	3'489'191.56	0.37	a)
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	500	0	0	500	USD	105.40 %	477'606.51	0.05	a)
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	2'325	0	0	2'325	USD	106.66 %	2'247'378.17	0.24	a)
US013051EK94	1.0000 % ALTA 1 05/20/25	1'500	0	0	1'500	USD	101.22 %	1'375'967.32	0.15	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	600	0	0	600	USD	90.52 %	492'224.22	0.05	a)
US02079KAH05	0.4500 % GOOGL 0.45 08/15/25	1'000	0	0	1'000	USD	99.42 %	901'052.52	0.10	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	0	4'500	1'500	3'000	USD	105.52 %	2'869'010.47	0.31	a)
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	0	1'500	0	1'500	USD	109.43 %	1'487'673.32	0.16	a)
US025816BW85	3.7000 % AXP 3.7 08/03/23	2'600	0	600	2'000	USD	106.40 %	1'928'624.53	0.21	a)
US03027XAX34	3.0000 % AMT 3 06/15/23	850	0	0	850	USD	104.66 %	806'245.84	0.09	a)
US03027XAX84	2.7500 % AMT 2 3/4 01/15/27	2'300	0	800	1'500	USD	106.42 %	1'446'699.50	0.15	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	1'000	0	0	1'000	USD	98.65 %	894'083.08	0.10	a)
US031162BY57	3.1250 % AMGN 3 1/8 05/01/25	1'000	0	0	1'000	USD	107.83 %	977'236.10	0.10	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	2'800	0	0	2'800	USD	103.24 %	2'619'910.29	0.28	a)
US037411BF15	4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	500	0	0	500	USD	104.56 %	473'804.58	0.05	a)
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	0	4'500	0	4'500	USD	99.21 %	4'046'131.04	0.43	a)
US04522KAA43	2.2500 % AIIB 2 1/4 05/16/24	1'500	0	0	1'500	USD	105.13 %	1'429'135.41	0.15	a)
US04522KAC09	0.2500 % AIIB 0 1/4 09/29/23	1'400	0	400	1'000	USD	99.91 %	905'448.08	0.10	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	1'600	0	0	1'600	USD	107.04 %	1'552'194.63	0.17	a)
US05578UAB08	5.1500 % BPCEGP 5.15 07/21/24 REGS	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US05578UAE47	4.8750 % BPCEGP 4 7/8 04/01/26 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	113.55 %	1'029'094.59	0.11	a)
US05968AAG13	2.7040 % BANCO 2.704 01/09/25 REGS	850	0	0	850	USD	104.57 %	805'552.52	0.09	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	600	0	0	600	USD	100.83 %	548'287.94	0.06	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	0	4'000	3'000	1'000	USD	101.86 %	923'175.31	0.10	a)
US06051GKB40	2.9720 % BAC 2.972 07/21/52	0	3'500	0	3'500	USD	101.08 %	3'206'244.70	0.34	a)
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	1'650	0	0	1'650	USD	103.75 %	1'551'442.40	0.17	a)
US06407F2C54	1.0000 % BZLNZ 1 03/03/26 REGS	0	1'500	0	1'500	USD	99.62 %	1'354'284.09	0.14	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	0	600	0	600	USD	99.18 %	539'331.88	0.06	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	2'200	0	0	2'200	USD	101.69 %	2'027'616.05	0.22	a)
US09659X2E17	3.5000 % BNP 3 1/2 03/01/23 REGS	2'000	0	0	2'000	USD	104.81 %	1'899'858.56	0.20	a)
US09659X2N16	1.3230 % BNP 1.323 01/13/27 REGS	1'400	0	0	1'400	USD	99.23 %	1'259'062.77	0.13	a)
US09660V2C60	2.8240 % BNP 2.824 01/26/41 REGS	2'400	0	900	1'500	USD	97.15 %	1'320'760.05	0.14	a)
US10112RBB96	3.4000 % BXP 3.4 06/21/29	1'550	0	0	1'550	USD	110.23 %	1'548'402.22	0.17	a)
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	1'250	0	0	1'250	USD	113.32 %	1'283'773.95	0.14	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	300	0	0	300	USD	123.30 %	335'226.78	0.04	a)
US110709AE21	1.3000 % BRCOL 1.3 01/29/31	4'000	0	4'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	0	3'000	0	3'000	USD	100.56 %	2'733'989.90	0.29	a)
US11135FBB67	3.1500 % AVGO 3.15 11/15/25	1'000	0	1'000	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	105.59 %	1'913'906.21	0.20	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	1'000	0	0	1'000	USD	98.95 %	896'765.72	0.10	a)
US135087K787	1.6250 % CANADA 1 5/8 01/22/25	1'140	0	1'140	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	900	0	0	900	USD	100.19 %	817'244.24	0.09	a)
US136375BL52	6.2500 % CNRCN 6 1/4 08/01/34	2'000	0	1'000	1'000	USD	143.40 %	1'299'607.01	0.14	a)
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	1'250	0	0	1'250	USD	114.17 %	1'293'426.05	0.14	a)
US149123CF65	3.2500 % CAT 3 1/4 09/19/49	1'200	0	0	1'200	USD	112.54 %	1'223'896.52	0.13	a)
US15089QAJ31	3.5000 % CE 3 1/2 05/08/24	900	0	0	900	USD	106.93 %	872'204.09	0.09	a)
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'600	0	0	1'600	USD	102.92 %	1'492'378.83	0.16	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	2'000	0	0	2'000	USD	109.78 %	1'989'781.65	0.21	a)
US172967MF56	3.3520 % C 3.352 04/24/25	2'700	0	0	2'700	USD	106.77 %	2'612'599.17	0.28	a)
US191216DP21	2.2500 % KO 2 1/4 01/05/32	0	2'100	0	2'100	USD	104.44 %	1'987'809.54	0.21	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	800	0	0	800	USD	105.57 %	765'417.48	0.08	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	2'900	0	0	2'900	USD	96.41 %	2'533'888.82	0.27	a)
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US222213AU49	1.3750 % COE 1 3/8 02/27/25	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US222213AV22	0.2500 % COE 0 1/4 06/10/23	1'500	0	0	1'500	USD	100.05 %	1'360'129.86	0.15	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US225433AC55	3.7500 % CS 3 3/4 03/26/25	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US22822VAJ08	3.1500 % CCI 3.15 07/15/23	1'000	0	0	1'000	USD	104.98 %	951'433.74	0.10	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	3'200	0	500	2'700	USD	100.29 %	2'454'203.96	0.26	a)
US24422EVR79	1.0500 % DE 1.05 06/17/26 MTN	0	2'150	0	2'150	USD	100.46 %	1'957'547.28	0.21	a)
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	2'500	0	0	2'500	USD	151.04 %	3'422'211.46	0.37	a)
US25243YAY59	3.5000 % DGELN 3 1/2 09/18/23	1'400	0	0	1'400	USD	106.34 %	1'349'301.25	0.14	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	650	0	0	650	USD	102.00 %	600'865.12	0.06	a)
US25243YBE86	2.1250 % DGELN 2 1/8 04/29/32	1'100	0	0	1'100	USD	102.09 %	1'017'725.96	0.11	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	1'200	0	0	1'200	USD	103.31 %	1'123'590.86	0.12	a)
US254687GA88	3.8000 % DIS 3.8 05/13/60	400	0	0	400	USD	120.13 %	435'488.03	0.05	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	0	1'750	0	1'750	USD	103.93 %	1'648'308.20	0.18	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	0	750	0	750	USD	99.09 %	673'539.50	0.07	a)
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	650	0	0	650	USD	105.23 %	619'910.56	0.07	a)
US29874QEH39	0.2500 % EBRD 0 1/4 07/10/23 GMTN	1'500	0	500	1'000	USD	100.03 %	906'599.08	0.10	a)
US298785HR03	2.8750 % EIB 2 7/8 08/15/23 GMTN	2'500	0	700	1'800	USD	105.33 %	1'718'290.42	0.18	a)
US298785JB33	1.6250 % EIB 1 5/8 03/14/25	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	2'110	0	0	2'110	USD	98.58 %	1'885'081.07	0.20	a)
US30231GAF90	2.7090 % XOM 2.709 03/06/25	1'800	0	1'800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US36830DAB73	2.9800 % PTTGC 2.98 03/18/31 REGS	0	1'200	0	1'200	USD	102.73 %	1'117'196.01	0.12	a)
US377372AH03	2.8000 % GSK 2.8 03/18/23	250	0	0	250	USD	104.05 %	235'760.35	0.03	a)
US404280BA69	3.6000 % HSBC 3.6 05/25/23	1'900	0	400	1'500	USD	105.76 %	1'437'740.73	0.15	a)
US404280CJ69	1.6450 % HSBC 1.645 04/18/26	900	0	0	900	USD	101.51 %	828'019.24	0.09	a)
US404280CL16	2.0130 % HSBC 2.013 09/22/28	2'600	0	0	2'600	USD	101.36 %	2'388'308.95	0.26	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	2'450	0	0	2'450	USD	107.93 %	2'396'559.90	0.26	a)
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	0	2'000	1'000	1'000	USD	100.27 %	908'765.14	0.10	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	100.22 %	908'257.61	0.10	a)
US4581XODG01	2.2500 % IADB 2 1/4 06/18/29	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US4581XODN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	3'200	0	1'200	2'000	USD	100.12 %	1'814'738.87	0.19	a)
US4581XODQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	2'000	0	0	2'000	USD	98.07 %	1'777'544.32	0.19	a)
US4581XODS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	3'250	0	3'250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058GE72	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/22/27 GDIF	850	0	850	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058HJ50	1.7500 % IBRD 1 3/4 10/23/29 GDIF	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058HT33	1.6250 % IBRD 1 5/8 01/15/25	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	1'500	0	500	1'000	USD	100.28 %	908'855.77	0.10	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	2'000	0	0	2'000	USD	99.12 %	1'796'612.87	0.19	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	900	0	900	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058JN45	0.7500 % IBRD 0 3/4 11/24/27	1'900	0	1'900	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US459058JX27	0.8750 % IBRD 0 7/8 07/15/26	0	3'300	0	3'300	USD	100.68 %	3'011'127.67	0.32	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	1'600	0	0	1'600	USD	102.19 %	1'481'894.76	0.16	a)
US45950KCP30	2.8750 % IFC 2 7/8 07/31/23 GMTN	1'750	0	0	1'750	USD	105.19 %	1'668'339.70	0.18	a)
US45950VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	2'000	0	0	2'000	USD	106.55 %	1'931'397.80	0.21	a)
US465410AH18	6.8750 % ITALY 6 7/8 09/27/23	2'000	0	0	2'000	USD	113.03 %	2'048'854.28	0.22	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	2'000	0	0	2'000	USD	128.91 %	2'336'640.79	0.25	a)
US465410BX58	2.3750 % ITALY 2 3/8 10/17/24	1'500	0	0	1'500	USD	104.35 %	1'418'626.86	0.15	a)
US465410BZ07	4.0000 % ITALY 4 10/17/49	3'000	0	1'000	2'000	USD	115.30 %	2'089'909.67	0.22	a)
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	4'000	0	0	4'000	USD	99.60 %	3'610'699.20	0.39	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	2'500	0	0	2'500	USD	108.30 %	2'453'739.28	0.26	a)
US471048BS61	3.2500 % JBIC 3 1/4 07/20/23	1'250	0	0	1'250	USD	105.66 %	1'196'950.41	0.13	a)
US478160CJ19	2.6250 % JNJ 2 5/8 01/15/25	825	0	0	825	USD	106.69 %	797'725.94	0.09	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	1'100	0	0	1'100	USD	98.82 %	985'126.35	0.11	a)
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	1'100	0	0	1'100	USD	105.85 %	1'055'200.56	0.11	a)
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	600	0	0	600	USD	99.11 %	538'945.80	0.06	a)
US50064FAR55	2.0000 % KOREA 2 06/19/24	2'000	0	0	2'000	USD	104.25 %	1'889'671.75	0.20	a)
US500769JC98	1.3750 % KFW 1 3/8 08/05/24	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US500769JF20	0.3750 % KFW 0 3/8 07/18/25	1'000	0	0	1'000	USD	99.16 %	898'678.02	0.10	a)
US500769JG03	0.7500 % KFW 0 3/4 09/30/30	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US500769JH85	0.2500 % KFW 0 1/4 10/19/23	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US501044DQ10	1.7000 % KR 1.7 01/15/31	1'000	0	0	1'000	USD	97.08 %	879'826.98	0.09	a)
US515110BY94	0.8750 % RENTEN 0 7/8 09/03/30	4'100	0	4'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US532457BV93	3.3750 % LLY 3 3/8 03/15/29	400	0	0	400	USD	113.44 %	411'231.81	0.04	a)
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	750	0	0	750	USD	103.70 %	704'854.43	0.08	a)
US563469UU76	2.6000 % MP 2.6 04/16/24 GX	500	0	500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	1'800	0	0	1'800	USD	106.42 %	1'736'137.28	0.19	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	1'100	0	1'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	600	0	0	600	USD	102.65 %	558'184.73	0.06	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	2'000	0	0	2'000	USD	99.59 %	1'805'077.71	0.19	a)
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	3'000	0	0	3'000	USD	99.03 %	2'692'553.86	0.29	a)
US59156RBH03	3.6000 % MET 3.6 04/10/24	650	0	0	650	USD	108.17 %	637'200.50	0.07	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	1'800	0	0	1'800	USD	98.90 %	1'613'313.69	0.17	a)
US61747YEC57	1.5120 % MS 1.512 07/20/27 GMTN	0	1'500	0	1'500	USD	100.88 %	1'371'426.62	0.15	a)
US63307A2M63	0.5500 % NACN 0.55 11/15/24 MTN	1'500	0	0	1'500	USD	99.80 %	1'356'785.48	0.14	a)
US63859VBF76	1.0000 % NWIDE 1 08/28/25 REGS	1'900	0	0	1'900	USD	100.08 %	1'723'416.45	0.18	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	0	500	0	500	USD	100.58 %	455'755.61	0.05	a)
US642869AM37	3.6250 % NBRNS 3 5/8 02/24/28	1'500	0	500	1'000	USD	115.63 %	1'047'981.88	0.11	a)
US65562QBQ73	0.5000 % NIB 0 1/2 01/21/26 GMTN	2'850	0	2'850	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	1'100	0	0	1'100	USD	104.72 %	1'043'945.22	0.11	a)
US676167CC18	0.5000 % OKB 0 1/2 02/02/26 GMTN	2'900	0	2'900	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US683234AQ19	1.0500 % ONT 1.05 05/21/27	2'300	0	0	2'300	USD	100.18 %	2'088'137.86	0.22	a)
US683234AS74	0.6250 % ONT 0 5/8 01/21/26	2'160	0	960	1'200	USD	99.49 %	1'082'035.20	0.12	a)
US68323AFG40	2.0000 % ONT 2 10/02/29	2'500	0	2'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US68323AFH23	1.6000 % ONT 1.6 02/25/31	0	1'900	400	1'500	USD	100.67 %	1'368'599.10	0.15	a)
US68329AAH14	1.2500 % ONTTFT 1 1/4 09/27/30 144A	2'700	0	1'200	1'500	USD	97.57 %	1'326'415.37	0.14	a)
US68389XBB01	2.5000 % ORCL 2 1/2 05/15/22	1'500	0	0	1'500	USD	101.39 %	1'378'387.14	0.15	a)
US713448DY13	3.0000 % PEP 3 10/15/27	1'450	0	0	1'450	USD	110.74 %	1'455'220.53	0.16	a)
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	2'000	0	0	2'000	USD	105.51 %	1'912'419.88	0.20	a)
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	1'250	0	0	1'250	USD	100.27 %	1'135'967.75	0.12	a)
US715638DE95	2.3920 % PERU 2.392 01/23/26	500	0	0	500	USD	102.51 %	464'510.47	0.05	a)
US717081EY56	1.7000 % PFE 1.7 05/28/30	800	0	0	800	USD	101.04 %	732'573.17	0.08	a)
US74005PBT03	1.1000 % LIN 1.1 08/10/30	1'900	0	0	1'900	USD	95.75 %	1'648'855.15	0.18	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	2'800	0	0	2'800	USD	99.03 %	2'512'898.01	0.27	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	5'000	0	0	5'000	USD	110.08 %	4'988'365.83	0.53	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	900	0	0	900	USD	105.51 %	860'588.95	0.09	a)
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	2'300	0	1'300	1'000	USD	99.59 %	902'556.98	0.10	a)
US748149AG65	2.6250 % Q 2 5/8 02/13/23	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	1'500	0	0	1'500	USD	105.56 %	1'434'981.04	0.15	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	3'100	0	1'100	2'000	USD	99.80 %	1'808'956.67	0.19	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	2'000	0	1'000	1'000	USD	105.67 %	957'650.96	0.10	a)
US78015K7H17	1.1500 % RY 1.15 06/10/25 MTN	1'000	0	0	1'000	USD	100.99 %	915'227.06	0.10	a)
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	0	1'000	0	1'000	USD	100.39 %	909'816.44	0.10	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	0	900	0	900	USD	101.01 %	823'891.95	0.09	a)
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	0	550	0	550	USD	104.19 %	519'330.74	0.06	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	3'500	0	1'500	2'000	USD	115.04 %	2'085'124.41	0.22	a)
US817826AF77	2.5000 % SVELEV 2 1/2 02/10/41 144A	1'150	0	0	1'150	USD	94.95 %	989'622.05	0.11	a)
US824348BK17	3.8000 % SHW 3.8 08/15/49	2'500	0	1'000	1'500	USD	116.86 %	1'588'694.05	0.17	a)
US83368TAU25	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/16/24 REGS	1'500	0	0	1'500	USD	104.64 %	1'422'542.07	0.15	a)
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'850	0	0	2'850	USD	99.80 %	2'577'840.75	0.28	a)
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	1'300	0	500	800	USD	105.32 %	763'575.88	0.08	a)
US85771PAF99	3.1500 % EQNR 3.15 01/23/22	1'000	0	0	1'000	USD	101.40 %	918'988.20	0.10	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	0	3'000	0	3'000	USD	102.98 %	2'799'787.28	0.30	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	1'700	0	0	1'700	USD	100.52 %	1'548'721.54	0.17	a)
US89114QCP19	0.7500 % TD 0 3/4 01/06/26 MTN	1'850	0	1'850	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	0	2'450	0	2'450	USD	100.98 %	2'242'173.06	0.24	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US89153VAQ23	3.4550 % TTEFP 3.455 02/19/29	2'500	0	0	2'500	USD	112.81 %	2'555'879.29	0.27	a)
US892331AC30	3.4190 % TOYOTA 3.419 07/20/23	1'650	0	0	1'650	USD	106.06 %	1'585'941.17	0.17	a)
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	750	0	0	750	USD	98.19 %	667'435.57	0.07	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	3'000	0	0	3'000	USD	140.22 %	3'812'407.59	0.41	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	9'000	3'000	6'500	5'500	USD	128.38 %	6'399'044.44	0.68	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	0	9'500	0	9'500	USD	122.84 %	10'576'662.61	1.13	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	3'000	12'000	4'000	11'000	USD	116.09 %	11'573'734.22	1.24	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	10'000	0	0	10'000	USD	108.20 %	9'806'448.77	1.05	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	500	0	0	500	USD	105.38 %	477'506.81	0.05	a)
US912828S356	1.3750 % T 1 3/8 06/30/23	3'200	0	3'200	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US912828XW50	1.7500 % T 1 3/4 06/30/22	3'000	0	0	3'000	USD	101.52 %	2'760'108.19	0.29	a)
US91324PCN06	3.3500 % UNH 3.35 07/15/22	250	0	0	250	USD	103.00 %	233'381.31	0.02	a)
US91324PDS83	2.8750 % UNH 2 7/8 08/15/29	700	0	700	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	500	0	0	500	USD	113.94 %	516'296.45	0.06	a)
US91324PDX78	2.0000 % UNH 2 05/15/30	600	0	0	600	USD	102.50 %	557'374.50	0.06	a)
US91324PED06	2.3000 % UNH 2.3 05/15/31	0	1'300	0	1'300	USD	104.16 %	1'227'238.05	0.13	a)
US91533BAF76	4.0000 % VTRS 4 06/22/50 144A	400	0	0	400	USD	108.19 %	392'210.39	0.04	a)
US92277GAN79	4.4000 % VTR 4.4 01/15/29	1'450	0	0	1'450	USD	116.87 %	1'535'829.57	0.16	a)
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	765	0	0	765	USD	115.67 %	801'934.93	0.09	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPPLN 3 3/4 09/19/24	1'600	0	0	1'600	USD	108.92 %	1'579'485.14	0.17	a)
US931142DH37	2.5500 % WMT 2.55 04/11/23	1'500	0	0	1'500	USD	103.40 %	1'405'725.68	0.15	a)
US931142ED14	3.5500 % WMT 3.55 06/26/25	1'900	0	0	1'900	USD	110.56 %	1'903'792.81	0.20	a)
US931142EM13	3.0500 % WMT 3.05 07/08/26	1'000	0	0	1'000	USD	110.05 %	997'346.90	0.11	a)
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	750	0	750	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	0	850	0	850	USD	100.87 %	777'087.90	0.08	a)
USC68012AA85	2.5000 % OMERFT 2 1/2 05/02/24 REGS	3'500	0	0	3'500	USD	105.40 %	3'343'372.42	0.36	a)
USG0398NZ620	2.3750 % ANTOLN 2 3/8 10/14/30 REGS	300	0	0	300	USD	96.95 %	263'594.64	0.03	a)
USG0446NAP99	4.5000 % AALLN 4 1/2 03/15/28 REGS	1'800	0	0	1'800	USD	115.33 %	1'881'440.74	0.20	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	0	650	0	650	USD	100.35 %	591'133.27	0.06	a)
USG8201NAG72	2.5000 % SINOPE 2 1/2 09/13/22 REGS	2'500	0	2'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	0	2'200	0	2'200	USD	100.13 %	1'996'511.83	0.21	a)
USH42097BT36	1.3640 % UBS 1.364 01/30/27 REGS	1'250	0	0	1'250	USD	100.01 %	1'133'010.95	0.12	a)
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	0	2'000	1'000	1'000	USD	99.44 %	901'215.66	0.10	a)
USH4209UAC02	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 REGS	1'800	0	0	1'800	USD	114.40 %	1'866'204.02	0.20	a)
USJ5S39RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	0	1'350	0	1'350	USD	100.46 %	1'229'169.83	0.13	a)
USJ7771YKP18	1.5500 % SUMITR 1.55 03/25/26 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	102.06 %	925'006.03	0.10	a)
USN39427AQ76	2.7500 % HEIANA 2 3/4 04/01/23 REGS	2'000	0	0	2'000	USD	103.63 %	1'878'469.88	0.20	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	2'600	0	0	2'600	USD	101.16 %	2'383'784.70	0.25	a)
USN82008AX66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 REGS	0	1'200	0	1'200	USD	100.75 %	1'095'694.95	0.12	a)
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	1'500	0	0	1'500	USD	108.68 %	1'477'409.48	0.16	a)
USU74078BY87	3.5000 % NESNVX 3 1/2 09/24/25 REGS	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU74078CD32	4.0000 % NESNVX 4 09/24/48 REGS	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	2'500	0	0	2'500	USD	106.10 %	2'403'915.44	0.26	a)
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	0	2'000	0	2'000	USD	100.62 %	1'823'910.62	0.19	a)
USU88868AJ08	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31 REGS	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	0	1'700	0	1'700	USD	100.61 %	1'550'139.15	0.17	a)
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	0	600	0	600	USD	99.11 %	538'962.11	0.06	a)
USY68856AM84	3.1250 % PETMK 3 1/8 03/18/22 REGS	1'950	0	1'950	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS0043037505	7.3750 % AFDB 7 3/8 04/06/23	3'000	0	1'500	1'500	USD	111.72 %	1'518'750.35	0.16	a)
XS1711039591	2.7500 % SDBC 2 3/4 11/16/22 EMTN	3'000	0	3'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS1717575259	2.3750 % NESNVX 2 3/8 11/17/22 EMTN	3'000	0	0	3'000	USD	102.64 %	2'790'733.34	0.30	a)
XS1800010693	4.0000 % ADCBUH 4 03/29/23 REGS	2'600	0	0	2'600	USD	105.52 %	2'486'405.05	0.27	a)
XS1865126004	3.1250 % DBJP 3 1/8 09/06/23 REGS	1'200	0	0	1'200	USD	105.71 %	1'149'692.30	0.12	a)
XS1865437930	3.8750 % STSP 3 7/8 08/28/28 EMTN	1'300	0	0	1'300	USD	114.37 %	1'347'543.03	0.14	a)
XS2045821811	1.7500 % DBJP 1 3/4 08/28/24 REGS	3'000	0	0	3'000	USD	103.63 %	2'817'568.88	0.30	a)
XS2156607884	0.7500 % BNG 0 3/4 04/17/23 REGS	1'600	0	1'600	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.07.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	850	0	0	850	USD	100.76 %	776'194.29	0.08	a)
XS2177026155	0.8750 % FINL 0 7/8 05/20/30 REGS	2'500	0	2'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2186093766	1.8750 % CHMEDA 1 7/8 06/17/25	600	0	0	600	USD	101.21 %	550'359.74	0.06	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	98.12 %	889'225.31	0.10	a)
XS2218776248	0.2500 % KOMINS 0 1/4 12/01/22 REGS	400	0	400	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2224639802	0.6250 % JFM 0 5/8 09/02/25 REGS	2'250	0	250	2'000	USD	99.05 %	1'795'434.68	0.19	a)
XS2225366694	0.8500 % SEB 0.85 09/02/25 REGS	3'000	0	0	3'000	USD	99.77 %	2'712'564.96	0.29	a)
XS2226989015	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 REGS	800	0	0	800	USD	98.80 %	716'310.52	0.08	a)
XS2230306537	2.0000 % COMQAT 2 09/15/25 EMTN	2'800	0	2'800	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	3'300	0	1'300	2'000	USD	101.01 %	1'830'816.63	0.20	a)
XS2233217558	1.7100 % EDPL 1.71 01/24/28 REGS	1'150	0	0	1'150	USD	99.92 %	1'041'421.63	0.11	a)
XS2233264550	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 REGS	1'600	0	0	1'600	USD	98.71 %	1'431'359.47	0.15	a)
XS2237442574	0.6250 % NDEVBB 0 5/8 09/29/25 EMTN	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2247546711	1.0000 % CADES 1 10/21/30 REGS	3'500	0	3'500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2249473724	0.6250 % KOLAHO 0 5/8 11/03/23 GMTN	400	0	0	400	USD	100.19 %	363'208.82	0.04	a)
XS2265251905	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 REGS	2'000	0	2'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2270152098	0.5000 % LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100	USD	99.15 %	2'785'649.00	0.30	a)
XS2280635256	1.6380 % EBIUH 1.638 01/13/26	4'000	0	0	4'000	USD	100.53 %	3'644'413.92	0.39	a)
XS2281989785	1.2500 % AGRBK 1 1/4 01/19/26 EMTN	1'800	0	0	1'800	USD	100.13 %	1'633'526.00	0.17	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	2'500	0	500	2'000	USD	100.25 %	1'817'113.56	0.19	a)
XS2291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	2'200	0	0	2'200	USD	99.19 %	1'977'610.04	0.21	a)
XS2296155562	1.3750 % JFM 1 3/8 02/10/31 REGS	0	2'100	2'100	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
XS2297244878	0.6250 % IDBINV 0 5/8 02/10/26 EMTN	0	2'800	0	2'800	USD	99.36 %	2'521'475.23	0.27	a)
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	0	3'500	1'000	2'500	USD	100.35 %	2'273'770.53	0.24	a)
XS2330932620	1.2500 % KORAIR 1 1/4 05/04/26	0	1'000	0	1'000	USD	100.32 %	909'200.25	0.10	a)
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	0	3'500	1'000	2'500	USD	101.02 %	2'288'860.65	0.24	a)
XS2336053959	1.1250 % NDEVBB 1 1/8 04/27/26 EMTN	0	2'500	0	2'500	USD	101.01 %	2'288'588.76	0.24	a)
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	0	3'500	0	3'500	USD	100.02 %	3'172'589.25	0.34	a)
XS2343566662	0.8750 % BNG 0 7/8 05/18/26 REGS	0	2'000	0	2'000	USD	100.69 %	1'825'179.44	0.20	a)
USD								349'341'931.62	37.32	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								46'129'301.69	4.93	
IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	10'477'252	0	0	10'477'252	USD	4.86	46'129'301.69	4.93	a)
USD								46'129'301.69	4.93	
Nicht kotierte Wertpapiere								22'527'593.13	2.41	
Strukturierte Produkte								22'527'593.13	2.41	
CH0473236351	ZKB TRACKER DYN LS BOND F 2025	2'609	0	0	2'609	CHF	8'634.57	22'527'593.13	2.41	a)
Diverse								22'527'593.13	2.41	
Derivative Finanzinstrumente								-70'844.34	-0.01	
Futures								0.00	0.00	
03/21	EURO-BUND FUTURE MAR21	0	165	165	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
03/21	US 10YR NOTE (CBT)MAR21	100	0	100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/21	EURO-BUND FUTURE JUN21	0	406	406	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
06/21	US 10YR NOTE (CBT)JUN21	0	883	883	0	USD	0.00	0.00	0.00	
09/21	EURO-BUND FUTURE SEP21	0	267	267	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/21	US 10YR NOTE (CBT)SEP21	0	836	1'136	-300	USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/21	US ULTRA BOND CBT SEP21	0	200	0	200	USD	0.00	0.00	0.00	a)
09/21	US 5YR NOTE (CBT) SEP21	0	0	50	-50	USD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EUR/USD Verfall 26.03.2021	USD	10'000'000	EUR	8'337'029	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 26.03.2021	EUR	8'253'576	USD	10'000'000	0.00	0.00	
EUR/CNY Verfall 07.04.2021	CNY	50'000'000	EUR	6'489'714	0.00	0.00	
USD/CNY Verfall 07.04.2021	CNY	50'000'000	USD	7'617'655	0.00	0.00	
GBP/USD Verfall 21.04.2021	USD	55'210	GBP	40'000	0.00	0.00	
GBP/CAD Verfall 20.05.2021	CAD	10'000'000	GBP	5'871'353	0.00	0.00	
GBP/CAD Verfall 24.06.2021	CAD	10'000'000	GBP	5'848'671	0.00	0.00	
GBP/CAD Verfall 26.07.2021	CAD	10'000'000	GBP	5'820'732	0.00	0.00	
EUR/USD Verfall 26.07.2021	USD	15'000'000	EUR	12'650'157	0.00	0.00	
CAD/GBP Verfall 26.07.2021	GBP	5'847'700	CAD	10'000'000	0.00	0.00	
EUR/USD Verfall 27.08.2021	USD	15'000'000	EUR	12'708'795	-70'844.34	-0.01	b)
Devisentermingeschäfte					-70'844.34	-0.01	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	12'121'126.34	1.30
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	850'916'511.37	90.91
Strukturierte Produkte	22'527'593.13	2.41
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	46'129'301.69	4.93
Derivative Finanzinstrumente	-70'844.34	-0.01
Sonstige Vermögenswerte	4'340'866.55	0.46
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	935'964'554.74	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-165'371.46	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	935'799'183.28	

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);	919'573'406.19	98.25
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-70'844.34	-0.01
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	0.66617582
CAD	1 = CHF	0.72599832
CNY	1 = CHF	0.14037452
DKK	100 = CHF	14.44786300
EUR	1 = CHF	1.07469377
GBP	1 = CHF	1.26007421
JPY	100 = CHF	0.82578600
MXN	1 = CHF	0.04563559
MYR	1 = CHF	0.21476303
NOK	100 = CHF	10.25823900
NZD	1 = CHF	0.63255209
PLN	1 = CHF	0.23540565
SEK	100 = CHF	10.53335000
SGD	1 = CHF	0.66930064
THB	100 = CHF	2.75743500
USD	1 = CHF	0.90630000
ZAR	1 = CHF	0.06195335

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	85'024'932.12	9.09
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	16'861'317.22	1.80
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
01.02.2021 – 31.07.2021	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	01.02.2021 – 31.07.2021	0.95 %	0.75 %	0.20 %	4.00 %
BA CHF	01.02.2021 – 31.07.2021	0.58 %	0.38 %	0.20 %	4.00 %
CT CHF	01.02.2021 – 31.07.2021	0.49 %	0.29 %	0.20 %	4.00 %
DA CHF	01.02.2021 – 31.07.2021	0.45 %	0.35 %	0.10 %	4.00 %
GT CHF	01.02.2021 – 31.07.2021	0.38 %	0.28 %	0.10 %	4.00 %
NT CHF	01.02.2021 – 31.07.2021	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.

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 zugewiesen 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 Beträge 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 falligen 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) fur die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssatze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Ertragen oder Kapitalertragen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Ertrage oder Kapitalertrage aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermogen, getatigt wurden.