

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CORPORATE HEDGED CHF

Halbjahresbericht per 31.07.2024

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

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	70090	CHF
BA CHF	20594694	CHF
CT CHF	37864032	CHF
DA CHF	2561682	CHF
DT CHF	35656961	CHF
GT CHF	19224150	CHF
MT CHF	51788926	CHF
NT CHF	19224149	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	20
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	20
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
8	Pauschale Verwaltungskommission	21
9	Benchmark	21
10	TER	21
11	Fussnoten	22
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2024	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021
	bis	31.07.2024	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'726'565'705.77	1'762'211'002.13	1'753'830'780.01	1'943'684'018.26
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		180'964'151.95	198'396'067.67	231'948'271.41	304'496'219.92
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'202'338.955	2'381'202.042	2'745'263.380	3'120'838.572
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.1691	83.3176	84.4904	97.5687
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		82.2841	83.2093	84.6509	97.4224
Ausschüttung je Anteil		-	1.60	1.85	1.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.05 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'106'031.38	10'513'162.22	20'662'831.91	25'048'683.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		129'757.259	132'652.392	257'044.488	270'023.269
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.8841	79.2535	80.3862	92.7649
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		77.9932	79.1504	80.5389	92.6258
Ausschüttung je Anteil		-	1.95	2.10	2.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.63 %	0.63 %	0.63 %	0.63 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'738'560.98	56'299'296.50	62'455'732.59	78'488'613.26
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		588'445.927	628'032.278	699'815.137	774'156.515
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.6235	89.6440	89.2460	101.3860
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		89.7489	89.5274	89.4156	101.2339
Thesaurierung je Anteil		-	2.14	2.25	2.37
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.57 %	0.57 %	0.57 %	0.57 %
Klasse DA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		55'142'576.51	66'594'545.50	75'248'041.30	75'406'133.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		653'868.940	776'621.518	864'971.866	750'128.820
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.3328	85.7490	86.9948	100.5242
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		84.4508	85.6376	87.1601	100.3735
Ausschüttung je Anteil		-	2.10	2.40	2.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		42'361'274.71	42'649'012.18	46'945'573.61	71'139'696.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		466'151.964	469'252.595	519'061.794	692'675.145
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.8744	90.8871	90.4431	102.7028
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.0016	90.7690	90.6150	102.5488
Thesaurierung je Anteil		-	2.24	2.34	2.47
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %

Klasse GT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	102'551'730.94	100'132'127.51	112'913'905.06	123'177'562.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'030'388.772	1'006'089.424	1'140'815.765	1'096'612.402
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	99.5272	99.5261	98.9765	112.3255
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	99.6666	99.3967	99.1645	112.1570
Thesaurierung je Anteil	-	2.54	2.66	2.82
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %

Klasse MT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'795'632.56	4'792'936.00	7'495'994.33	8'774'359.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	53'867.517	53'867.517	84'932.517	87'812.517
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	89.0264	88.9764	88.2582	99.9215
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	89.1511	88.8607	88.4259	99.7716
Thesaurierung je Anteil	-	2.63	2.72	2.92
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'277'905'746.74	1'282'833'854.55	1'196'160'429.80	1'257'152'749.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	12'465'861.581	12'522'394.937	11'771'338.273	10'927'496.357
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	102.5124	102.4432	101.6164	115.0449
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	102.6559	102.3100	101.8094	114.8723
Thesaurierung je Anteil	-	3.00	3.14	3.36
Total Expense Ratio (Synthetische TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	0.87 %	3.94 %	-16.78 %	-2.70 %
Klasse BA CHF	1.08 %	4.38 %	-16.43 %	-2.29 %
Klasse CT CHF	1.11 %	4.43 %	-16.38 %	-2.24 %
Klasse DA CHF	0.87 %	4.88 %	-16.51 %	-2.17 %
Klasse DT CHF	0.87 %	4.88 %	-16.51 %	-2.16 %
Klasse GT CHF	0.92 %	4.99 %	-16.42 %	-2.07 %
Klasse MT CHF	1.40 %	5.03 %	-15.90 %	-1.68 %
Klasse NT CHF	1.12 %	5.41 %	-16.09 %	-1.68 %

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)	31.07.2024	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	22'248'423.21	30'161'808.06
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'575'787'244.71	1'612'015'134.08
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	96'730'186.62	93'376'968.16
Derivative Finanzinstrumente	12'707'700.22	8'035'074.97
Sonstige Vermögenswerte	19'378'098.34	18'930'518.30
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'726'851'653.10	1'762'519'503.57
Andere Verbindlichkeiten	-285'947.33	-308'501.44
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'726'565'705.77	1'762'211'002.13

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'381'202.042	2'745'263.380
Ausgegebene Anteile		36'234.258	89'957.103
Zurückgenommene Anteile		-215'097.345	-454'018.441
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'202'338.955	2'381'202.042
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		132'652.392	257'044.488
Ausgegebene Anteile		16'320.640	23'775.415
Zurückgenommene Anteile		-19'215.773	-148'167.511
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		129'757.259	132'652.392
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		628'032.278	699'815.137
Ausgegebene Anteile		9'530.994	35'430.604
Zurückgenommene Anteile		-49'117.345	-107'213.463
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		588'445.927	628'032.278
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		776'621.518	864'971.866
Ausgegebene Anteile		31'281.307	51'217.383
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		4'134.719	-
Zurückgenommene Anteile		-158'168.604	-139'567.731
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		653'868.940	776'621.518
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		469'252.595	519'061.794
Ausgegebene Anteile		14'932.815	22'407.120
Zurückgenommene Anteile		-18'033.446	-72'216.319
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		466'151.964	469'252.595
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'006'089.424	1'140'815.765
Ausgegebene Anteile		57'995.791	194'490.350
Zurückgenommene Anteile		-33'696.443	-329'216.691
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'030'388.772	1'006'089.424
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		53'867.517	84'932.517
Zurückgenommene Anteile		-	-31'065.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		53'867.517	53'867.517
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'522'394.937	11'771'338.273
Ausgegebene Anteile		170'949.534	1'351'307.753
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		286'225.757	-
Zurückgenommene Anteile		-513'708.647	-600'251.089
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'465'861.581	12'522'394.937

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'762'211'002.13	1'753'830'780.01
Ausbezahlte Ausschüttung		-5'611'525.75	-7'416'429.81
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-14'895'430.39	-15'404'195.70
Saldo aus dem Anteilverkehr		-31'841'789.42	878'425.33
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		16'703'449.20	30'322'422.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'726'565'705.77	1'762'211'002.13

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		411'152.36	612'921.61
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-647.70	-1'743.64
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		28'991'115.18	48'254'471.30
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		0.00	2'759'557.07
Erträge aus Wertpapierleihe		160'658.45	368'868.75
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		299'687.45	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		215'029.63	2'448'339.98
Total Ertrag		30'076'995.37	54'442'415.07
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-1'624'209.95	-3'590'477.51
Sonstige Aufwendungen		-210.00	-504.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-893'060.05	-2'401'663.16
Total Aufwand		-2'517'480.00	-5'992'644.67
Nettoertrag / Verlust			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-99'972'960.42	-380'924.25
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		124'246.88	426'081.76
Realisierter Erfolg		-72'289'198.17	48'494'927.91
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		88'992'647.37	-18'172'505.61
Gesamterfolg		16'703'449.20	30'322'422.30

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'575'787'244.71	91.25	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'575'787'244.71	91.25	
AU3CB0243764	4.0000 % TLSAU 4 04/19/27 MTN	11'000	0	0	11'000 AUD	98.54%	6'230'775.26	0.36	a)
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	5'550	0	0	5'550 AUD	99.79%	3'183'331.10	0.18	a)
AUD							9'414'106.36	0.55	
CA00206RDY59	4.8500 % T 4.85 05/25/47 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	92.97%	1'184'783.55	0.07	a)
CA06368LB887	4.5370 % BMO 4.537 12/18/28	2'000	0	0	2'000 CAD	101.69%	1'295'948.20	0.08	a)
CA0641515959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	10'000	0	0	10'000 CAD	97.85%	6'235'058.99	0.36	a)
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	3'000	0	0	3'000 CAD	74.97%	1'433'052.98	0.08	a)
CA07813ZCE21	2.5000 % BCECN 2 1/2 05/14/30 MTN	4'000	1'000	0	5'000 CAD	90.83%	2'893'811.10	0.17	a)
CA29251ZBU09	3.1000 % ENBCN 3.1 09/21/33 MTN	10'000	0	0	10'000 CAD	88.95%	5'667'702.52	0.33	a)
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	5'000	0	0	5'000 CAD	93.42%	2'976'295.71	0.17	a)
CA775109BJ98	3.2500 % RCICN 3 1/4 05/01/29	5'000	0	0	5'000 CAD	95.46%	3'041'161.94	0.18	a)
CA780086WK63	5.0100 % RY 5.01 02/01/33	11'000	0	0	11'000 CAD	101.85%	7'138'649.35	0.41	a)
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	9'000	0	0	9'000 CAD	93.60%	5'367'712.15	0.31	a)
CA89117FPG86	3.0600 % TD 3.06 01/26/32 MTN	13'000	0	0	13'000 CAD	96.84%	8'021'416.26	0.46	a)
CAD							45'255'592.75	2.62	
CH0361532945	3.6000 % ZKB 3.6 PERP	6'500	0	0	6'500 CHF	100.25%	6'516'250.00	0.38	a)
CH1151526204	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 05/03/52	4'000	0	0	4'000 CHF	96.55%	3'862'000.00	0.22	a)
CHF							10'378'250.00	0.60	
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	95.23%	3'628'291.56	0.21	a)
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002961424	8.0000 % KBCBB 8 PERP	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6317598850	3.8750 % AGSBB 3 7/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	87.19%	1'826'995.24	0.11	a)
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	3'000	0	0	3'000 EUR	84.62%	2'418'003.77	0.14	a)
BE6350791073	3.8750 % SOLBBB 3 7/8 04/03/28	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	90.27%	5'159'082.43	0.30	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	6'000	2'000	0	8'000 EUR	99.93%	7'614'501.10	0.44	a)
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	90.74%	4'321'476.65	0.25	a)
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	8'000	0	0	8'000 EUR	80.71%	6'150'062.59	0.36	a)
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	109.14%	2'079'193.30	0.12	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	4'900	0	4'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	106.56%	2'537'530.43	0.15	a)
DE000DL19V55	4.5000 % DB 4 1/2 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	90.93%	3'464'458.55	0.20	a)
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'400	0	0	1'400 EUR	96.75%	1'290'184.95	0.07	a)
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	99.04%	6'603'680.00	0.38	a)
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	8'000	0	0	8'000 EUR	104.50%	7'963'046.30	0.46	a)
FR0013331949	3.1250 % FRPTT 3 1/8 PERP	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	5'100	0	0	5'100 EUR	86.45%	4'199'504.87	0.24	a)
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	94.52%	1'800'677.18	0.10	a)
FR00140046Y4	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 PERP	4'500	0	0	4'500 EUR	83.88%	3'595'544.01	0.21	a)
FR0014006KD4	1.1250 % BFCM 1 1/8 11/19/31 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	81.73%	3'892'605.64	0.23	a)
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	4'600	0	0	4'600 EUR	89.95%	3'941'100.21	0.23	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	4'400	0	0	4'400 EUR	103.93%	4'355'870.15	0.25	a)
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	104.74%	2'095'160.35	0.12	a)
FR001400KKC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	104.94%	2'199'120.97	0.13	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	103.83%	5'933'993.52	0.34	a)
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400OX54	4.5000 % ORAFP 4 1/2 PERP	0	3'700	0	3'700 EUR	100.52%	3'542'641.19	0.21	a)
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	0	1'700	0	1'700 EUR	104.36%	1'689'864.15	0.10	a)
PTEDP4OM0025	5.9430 % EDPL 5.943 04/23/2083 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	6'000	0	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1548475968	7.7500 % ISPIAM 7 3/4 PERP	3'000	0	1'000	2'000 EUR	103.77%	1'976'873.87	0.11	a)
XS1693822634	4.7500 % ABNANV 4 3/4 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	94.93%	3'616'937.55	0.21	a)
XS1700709683	4.6250 % ASRNED 4 5/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	94.32%	3'593'581.82	0.21	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	5'000	0	0	5'000 EUR	94.41%	4'496'406.48	0.26	a)
XS1793250041	4.7500 % SANTAN 4 3/4 PERP	5'000	0	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877860533	4.6250 % RABOBK 4 5/8 PERP	6'000	0	4'000	2'000 EUR	98.54%	1'877'164.34	0.11	a)
XS2010028343	2.8750 % SESGFP 2 7/8 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	95.11%	3'623'605.17	0.21	a)
XS2010039548	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010039548XXX	1.6000 % DBHNGR 1.6 PERP CB (RETIRED)	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2022424993	1.7500 % ISPIAM 1 3/4 07/04/29 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050933972	3.2500 % RABOBK 3 1/4 PERP	5'000	0	0	5'000 EUR	93.25%	4'441'112.84	0.26	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	8'000	0	4'000	4'000 EUR	87.59%	3'337'049.81	0.19	a)
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	87.82%	4'182'647.22	0.24	a)
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	3'800	0	800	3'000 EUR	89.35%	2'553'194.58	0.15	a)
XS2102912966	4.3750 % SANTAN 4 3/8 PERP	1'000	0	0	1'000 EUR	96.90%	922'989.46	0.05	a)
XS2109819859	2.5020 % TELEFO 2.502 PERP	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2131567138	4.3750 % ABNANV 4 3/8 PERP	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182055009	3.7500 % DSFIR 3 3/4 PERP	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	4'000	0	0	4'000 EUR	99.27%	3'782'256.49	0.22	a)
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	93.59%	2'674'411.96	0.15	a)
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	6'150	0	0	6'150 EUR	96.24%	5'637'663.90	0.33	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	6'000	0	0	6'000 EUR	90.40%	5'166'340.62	0.30	a)
XS2201857534	2.4290 % ASSGEN 2.429 07/14/31 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2202900424	4.3750 % RABOBK 4 3/8 PERP	5'000	4'000	0	9'000 EUR	96.15%	8'242'953.09	0.48	a)
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	3'000	0	0	3'000 EUR	96.13%	2'746'822.34	0.16	a)
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	6'000	0	0	6'000 EUR	87.79%	5'017'404.98	0.29	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	88.34%	4'207'126.92	0.24	a)
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	2'800	0	800	2'000 EUR	81.44%	1'551'441.45	0.09	a)
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	89.77%	4'275'279.55	0.25	a)
XS2271225281	1.5000 % GYCGR 1 1/2 PERP EMTN	4'300	0	1'300	3'000 EUR	73.14%	2'089'871.02	0.12	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	6'000	0	0	6'000 EUR	91.73%	5'242'522.97	0.30	a)
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	84.52%	4'025'529.46	0.23	a)
XS2332245377	3.1000 % RABOBK 3.1 PERP	0	2'000	0	2'000 EUR	88.11%	1'678'431.09	0.10	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	4'500	0	0	4'500 EUR	93.74%	4'017'918.84	0.23	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	92.04%	4'383'676.04	0.25	a)
XS2353073161	2.6250 % POSIM 2 5/8 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	7'000	0	0	7'000 EUR	87.77%	5'852'172.27	0.34	a)
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	4'400	0	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	7'000	0	0	7'000 EUR	87.57%	5'838'503.64	0.34	a)
XS2381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	8'000	0	0	8'000 EUR	81.36%	6'199'441.10	0.36	a)
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	3'400	0	1'000	2'400 EUR	91.51%	2'091'842.73	0.12	a)
XS2388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	2'000	0	0	2'000 EUR	84.09%	1'601'867.73	0.09	a)
XS2405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	1'300	0	0	1'300 EUR	92.13%	1'140'758.77	0.07	a)
XS2410367747	2.8800 % TELEFO 2.88 PERP	3'100	0	0	3'100 EUR	94.37%	2'786'502.31	0.16	a)
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	7'500	0	5'000	2'500 EUR	83.30%	1'983'522.44	0.11	a)
XS2434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	90.80%	2'594'743.40	0.15	a)
XS2437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	2'200	0	0	2'200 EUR	93.68%	1'962'995.69	0.11	a)
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	3'500	0	0	3'500 EUR	83.63%	2'787'999.67	0.16	a)
XS2462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	600	3'000	0	3'600 EUR	108.89%	3'734'009.57	0.22	a)
XS2464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	3'300	0	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	6'800	0	2'800	4'000 EUR	92.43%	3'521'762.00	0.20	a)
XS2526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	7'000	0	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	5'600	0	2'600	3'000 EUR	101.99%	2'914'417.79	0.17	a)
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	2'800	0	0	2'800 EUR	106.05%	2'828'485.48	0.16	a)
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	3'700	0	0	3'700 EUR	113.16%	3'988'149.81	0.23	a)
XS2554581830	7.0000 % ASRNE7 12/07/43	2'000	0	0	2'000 EUR	115.55%	2'201'267.94	0.13	a)
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	102.40%	4'876'937.23	0.28	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	8'000	0	3'000	5'000 EUR	102.24%	4'869'221.83	0.28	a)
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	106.01%	1'514'659.99	0.09	a)
XS2592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	4'800	0	0	4'800 EUR	106.19%	4'855'278.88	0.28	a)
XS2592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	5'350	0	5'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	2'500	0	0	2'500 EUR	104.55%	2'489'547.36	0.14	a)
XS2598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	3'800	0	0	3'800 EUR	101.91%	3'688'772.61	0.21	a)
XS2602037629	6.3750 % NNGRNV 6 3/8 PERP	0	7'000	0	7'000 EUR	101.65%	6'777'838.30	0.39	a)
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	6'800	0	0	6'800 EUR	105.28%	6'819'240.43	0.39	a)
XS2629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	103.52%	3'944'108.26	0.23	a)
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	106.14%	4'043'932.10	0.23	a)
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	3'000	0	0	3'000 EUR	106.23%	3'035'463.72	0.18	a)
XS2646608401	6.7500 % TELEFO 6 3/4 PERP	4'300	0	0	4'300 EUR	109.02%	4'465'268.69	0.26	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	3'600	0	0	3'600 EUR	109.47%	3'753'932.43	0.22	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFNNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	2'900	0	0	2'900 EUR	105.31%	2'909'006.54	0.17	a)
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	3'800	0	0	3'800 EUR	106.44%	3'852'702.78	0.22	a)
XS2694995163	3.6250 % ASRNE3 5/8 12/12/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2708134023	7.8620 % VARN0 7.862 11/15/2083	5'000	0	0	5'000 EUR	109.50%	5'215'033.31	0.30	a)
XS2711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	108.28%	1'547'078.92	0.09	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	8'300	0	0	8'300 EUR	107.00%	8'459'466.04	0.49	a)
XS2726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	4'300	0	0	4'300 EUR	106.62%	4'367'132.71	0.25	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	5'450	0	5'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2731506841	3.7500 % MET 3 3/4 12/07/31 GMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	4'100	0	0	4'100 EUR	103.67%	4'048'725.16	0.23	a)
XS2747610751	3.8750 % ABNANV 3 7/8 01/15/32 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	101.73%	2'906'959.58	0.17	a)
XS2750308483	4.7500 % ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN	3'900	0	0	3'900 EUR	101.89%	3'785'028.31	0.22	a)
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	5'300	0	1'300	4'000 EUR	103.32%	3'936'640.53	0.23	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	2'000	0	0	2'000 EUR	103.25%	1'966'948.64	0.11	a)
XS2764455619	3.8750 % KPN 3 7/8 02/16/36 GMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2770512064	4.7500 % ENELIM 4 3/4 PERP	0	7'400	0	7'400 EUR	100.31%	7'070'621.22	0.41	a)
XS2774944008	6.8750 % ABNANV 6 7/8 PERP	0	5'000	0	5'000 EUR	103.16%	4'913'275.77	0.28	a)
XS2776511730	3.6250 % BKNG 3 5/8 03/01/32	0	4'400	0	4'400 EUR	101.98%	4'274'227.97	0.25	a)
XS2779901482	4.1250 % AALLN 4 1/8 03/15/32	0	3'200	0	3'200 EUR	101.82%	3'103'500.14	0.18	a)
XS2782109016	4.2500 % SABSM 4 1/4 09/13/30 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	102.82%	1'566'944.63	0.09	a)
XS2794589403	5.1250 % BRITEL 5 1/8 10/03/54 EMTN	0	3'400	0	3'400 EUR	101.76%	3'295'558.15	0.19	a)
XS2798269069	4.7500 % TRNIM 4 3/4 PERP	0	4'900	0	4'900 EUR	99.44%	4'640'965.30	0.27	a)
XS2824778075	4.8750 % KPN 4 7/8 PERP	0	3'900	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2826616596	3.6250 % CLNXSM 3 5/8 01/24/29 EMTN	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2829852842	4.5000 % ALLRNV 4 1/2 PERP	0	2'500	0	2'500 EUR	101.05%	2'406'225.90	0.14	a)
XS2830327446	5.0000 % AEMSPA 5 PERP	0	2'250	0	2'250 EUR	100.76%	2'159'388.13	0.13	a)
XS2855975285	4.3750 % GYCGR 4 3/8 01/09/30 EMTN	0	900	0	900 EUR	100.51%	861'603.51	0.05	a)
XS2872909770	3.2780 % AZN 3.278 08/05/33 EMTN	0	4'500	0	4'500 EUR	100.32%	4'300'130.73	0.25	a)
EUR							382'413'611.11	22.15	
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	94.09%	3'191'279.77	0.18	a)
XS0730243150	4.8750 % ORSTED 4 7/8 01/12/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	99.44%	2'248'611.08	0.13	a)
XS0903532090	5.6250 % NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0932036154	4.2500 % T 4 1/4 06/01/43	5'000	0	0	5'000 GBP	83.61%	4'726'345.78	0.27	a)
XS1242413166	5.1250 % AVLN 5 1/8 06/04/50 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	96.68%	2'186'177.30	0.13	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 GBP	95.67%	8'653'805.99	0.50	a)
XS1492680902	2.1250 % CDTFIN 2 1/8 09/22/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	90.11%	2'037'634.20	0.12	a)
XS1492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	3'500	0	0	3'500 GBP	71.17%	2'816'400.08	0.16	a)
XS1891174424	3.7500 % DLR 3 3/4 10/17/30	2'500	0	0	2'500 GBP	92.18%	2'605'638.02	0.15	a)
XS2170609072	1.6250 % GSK 1 5/8 05/12/35 EMTN	5'000	0	0	5'000 GBP	74.10%	4'188'953.96	0.24	a)
XS2195190876	3.7400 % SSELN 3.74 PERP	2'000	0	0	2'000 GBP	97.04%	2'194'408.34	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2528657567	7.5940 % BKIR 7.594 12/06/32 EMTN	5'600	0	0	5'600 GBP	104.48%	6'615'348.69	0.38	a)
XS2636324274	8.3750 % BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN	3'000	0	0	3'000 GBP	107.31%	3'639'893.97	0.21	a)
XS2685873908	6.8000 % HSBC 6.8 09/14/31	3'500	0	0	3'500 GBP	108.85%	4'307'563.45	0.25	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	4'000	0	0	4'000 GBP	105.61%	4'776'082.51	0.28	a)
GBP							54'188'143.14	3.14	
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	360'000	0	0	360'000 JPY	99.58%	2'097'273.55	0.12	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	360'000	0	0	360'000 JPY	98.19%	2'068'103.50	0.12	a)
XS1702964351	2.1080 % AFL 2.108 10/23/47	200'000	0	0	200'000 JPY	100.11%	1'171'318.28	0.07	a)
JPY							5'336'695.33	0.31	
BE6329851198	1.2610 % EUROCL 1.261 08/03/26 EMTN	5'000	300	0	5'300 USD	92.96%	4'337'026.08	0.25	a)
CH0286864027	6.8750 % UBS 6 7/8 PERP	5'000	0	0	5'000 USD	99.77%	4'391'127.13	0.25	a)
FR0013322823	5.2500 % SCOR 5 1/4 PERP	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002RQ0	4.8750 % CNPFP 4 7/8 PERP	0	5'000	0	5'000 USD	85.64%	3'769'010.44	0.22	a)
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	3'000	0	0	3'000 USD	94.35%	2'491'600.44	0.14	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	10'000	0	0	10'000 USD	69.90%	6'152'507.38	0.36	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	3'540	0	0	3'540 USD	69.38%	2'161'908.61	0.13	a)
US00206RMM15	2.5500 % T 2.55 12/01/33	0	467	0	467 USD	81.85%	336'470.43	0.02	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	10'000	0	0	10'000 USD	93.15%	8'199'880.85	0.47	a)
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	5'000	0	0	5'000 USD	98.80%	4'348'523.03	0.25	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	10'000	300	0	10'300 USD	93.79%	8'503'812.69	0.49	a)
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	0	200	0	200 USD	94.52%	166'393.66	0.01	a)
US00774MAX39	3.3000 % AER 3.3 01/30/32	4'000	200	0	4'200 USD	88.07%	3'256'139.82	0.19	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	1'000	150	0	1'150 USD	102.40%	1'036'612.77	0.06	a)
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	3'100	150	0	3'250 USD	99.13%	2'836'009.26	0.16	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	20'000	0	0	20'000 USD	74.32%	13'084'036.00	0.76	a)
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	100	0	100 USD	96.35%	84'815.61	0.00	a)
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	10'000	0	0	10'000 USD	85.86%	7'558'090.58	0.44	a)
US023135CA22	2.8750 % AMZN 2 7/8 05/12/41	10'000	0	0	10'000 USD	76.06%	6'695'533.60	0.39	a)
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	4'600	0	0	4'600 USD	93.33%	3'779'112.19	0.22	a)
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	5'000	0	0	5'000 USD	98.87%	4'351'427.85	0.25	a)
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	1'450	100	0	1'550 USD	103.66%	1'414'255.86	0.08	a)
US03027XAP50	3.5500 % AMT 3.55 07/15/27	0	200	0	200 USD	96.33%	169'580.16	0.01	a)
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	5'110	0	0	5'110 USD	74.53%	3'352'462.14	0.19	a)
US03027XBA72	2.9000 % AMT 2.9 01/15/30	2'500	250	0	2'750 USD	90.46%	2'189'826.53	0.13	a)
US03027XBG43	1.8750 % AMT 1 7/8 10/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	83.68%	3'683'010.01	0.21	a)
US03027XBJ81	1.5000 % AMT 1 1/2 01/31/28	3'400	0	0	3'400 USD	89.34%	2'673'901.98	0.15	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	7'000	0	0	7'000 USD	97.75%	6'022'987.39	0.35	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	5'019	0	0	5'019 USD	86.73%	3'831'709.50	0.22	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	12'000	0	0	12'000 USD	72.23%	7'629'760.53	0.44	a)
US031162DD92	3.0000 % AMGN 3 02/22/29	0	100	0	100 USD	93.47%	82'280.49	0.00	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	5'000	0	0	5'000 USD	100.77%	4'435'051.60	0.26	a)
US034863AX89	2.6250 % AALLN 2 5/8 09/10/30 144A	5'000	0	0	5'000 USD	87.15%	3'835'469.31	0.22	a)
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	12'000	0	0	12'000 USD	103.95%	10'980'132.87	0.64	a)
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	96.95%	4'267'099.90	0.25	a)
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000	0	0	15'000 USD	80.18%	10'586'502.68	0.61	a)
US037833EB24	0.7000 % AAPL 0.7 02/08/26	0	100	0	100 USD	94.47%	83'153.70	0.00	a)
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	4'000	200	4'000	200 USD	97.16%	171'053.70	0.01	a)
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	2'500	0	0	2'500 USD	62.22%	1'369'272.89	0.08	a)
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	0	100	0	100 USD	90.41%	79'583.40	0.00	a)
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	5'000	0	0	5'000 USD	102.08%	4'492'884.03	0.26	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	0	200	0	200 USD	96.83%	170'462.17	0.01	a)
US052769AG12	2.8500 % ADSK 2.85 01/15/30	5'000	0	0	5'000 USD	91.10%	4'009'626.78	0.23	a)
US052769AH94	2.4000 % ADSK 2.4 12/15/31	2'615	0	0	2'615 USD	84.79%	1'951'695.76	0.11	a)
US05565QDU94	4.3750 % BPLN 4 3/8 PERP	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565QDV77	4.8750 % BPLN 4 7/8 PERP	0	2'000	0	2'000 USD	94.87%	1'670'221.56	0.10	a)
US05565QDW50	6.4500 % BPLN 6.45 PERP	0	1'800	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US058498AW66	2.8750 % BALL 2 7/8 08/15/30	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05946KAK79	5.8620 % BBVASM 5.862 09/14/26	0	200	0	200 USD	100.53%	176'984.83	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	4'000	0	4'000 USD	101.92%	3'588'427.15	0.21	a)
US05964HBB06	5.5380 % SANTAN 5.538 03/14/30	0	4'000	0	4'000 USD	101.00%	3'556'033.95	0.21	a)
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	5'000	400	0	5'400 USD	85.44%	4'061'404.84	0.24	a)
US06051GGC78	4.1830 % BAC 4.183 11/25/27 L	0	200	0	200 USD	97.80%	172'168.10	0.01	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	10'000	0	0	10'000 USD	95.49%	8'405'331.20	0.49	a)
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	10'000	0	0	10'000 USD	86.14%	7'582'473.50	0.44	a)
US06051GHX07	2.8840 % BAC 2.884 10/22/30 MTN	4'000	500	0	4'500 USD	90.72%	3'593'492.99	0.21	a)
US06051GJW06	3.3110 % BAC 3.311 04/22/42	7'000	0	0	7'000 USD	77.35%	4'765'990.39	0.28	a)
US06368EDC30	0.9490 % BMO 0.949 01/22/27 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	94.31%	4'150'862.89	0.24	a)
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	7'500	0	2'500	5'000 USD	97.44%	4'288'357.94	0.25	a)
US06407FZE11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	7'750	300	0	8'050 USD	94.06%	6'664'819.92	0.39	a)
US06407FZF85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	8'000	0	0	8'000 USD	86.43%	6'086'541.44	0.35	a)
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	6'000	0	0	6'000 USD	84.86%	4'482'092.16	0.26	a)
US06675FAZ09	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	99.88%	4'396'100.54	0.25	a)
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	0	400	0	400 USD	98.84%	347'998.04	0.02	a)
US06738ECN31	9.6250 % BACR 9 5/8 PERP	2'200	0	0	2'200 USD	109.13%	2'113'260.19	0.12	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	6'000	200	0	6'200 USD	89.94%	4'908'738.77	0.28	a)
US075887BX67	4.6690 % BDX 4.669 06/06/47	5'000	0	0	5'000 USD	89.45%	3'936'742.08	0.23	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	5'000	125	0	5'125 USD	83.84%	3'782'077.75	0.22	a)
US0778FPAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	6'000	0	0	6'000 USD	74.49%	3'934'242.17	0.23	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	87.03%	1'532'163.15	0.09	a)
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09660V2A05	4.3750 % BNP 4 3/8 03/01/33 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	95.92%	4'221'502.95	0.24	a)
US09660V2B87	2.5880 % BNP 2.588 08/12/35 REGS	0	400	0	400 USD	84.58%	297'813.22	0.02	a)
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	5'000	0	0	5'000 USD	95.10%	4'185'412.70	0.24	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	5'000	0	0	5'000 USD	76.34%	3'360'046.29	0.19	a)
US11135FBT75	4.1500 % AVGO 4.15 04/15/32 144A	0	300	0	300 USD	94.25%	248'888.05	0.01	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	10'000	0	0	10'000 USD	88.14%	7'758'699.55	0.45	a)
US126650DM98	1.3000 % CVS 1.3 08/21/27	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	2'250	0	0	2'250 USD	82.14%	1'626'754.82	0.09	a)
US12704PAA66	5.2000 % CRHID 5.2 05/21/29	0	10'000	2'000	8'000 USD	101.72%	7'162'770.30	0.41	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'600	0	0	2'600 USD	88.25%	2'019'756.51	0.12	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	6'000	0	0	6'000 USD	90.39%	4'773'947.85	0.28	a)
US161175BX17	2.3000 % CHTR 2.3 02/01/32	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175CC60	4.4000 % CHTR 4.4 12/01/61	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33 144A	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411QAQ47	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33	0	6'250	0	6'250 USD	103.70%	5'705'175.33	0.33	a)
US172967HB08	5.5000 % C 5 1/2 09/13/25	6'000	0	0	6'000 USD	100.31%	5'298'083.91	0.31	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	6'000	0	0	6'000 USD	96.04%	5'072'299.79	0.29	a)
US17325FBK30	4.8380 % C 4.838 08/06/29	0	4'325	0	4'325 USD	100.52%	3'827'030.36	0.22	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	3'700	400	0	4'100 USD	86.83%	3'133'788.59	0.18	a)
US191216DC18	2.5000 % KO 2 1/2 03/15/51	10'000	0	0	10'000 USD	62.52%	5'503'234.98	0.32	a)
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	5'000	350	0	5'350 USD	90.51%	4'262'327.18	0.25	a)
US191241AJ70	1.8500 % KOF 1.85 09/01/32	2'250	0	0	2'250 USD	80.11%	1'586'608.81	0.09	a)
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	1'300	100	0	1'400 USD	104.32%	1'285'599.84	0.07	a)
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	2'000	0	0	2'000 USD	96.93%	1'706'452.65	0.10	a)
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	9'242	0	1'242	8'000 USD	80.05%	5'637'402.68	0.33	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	10'000	300	0	10'300 USD	82.03%	7'436'858.14	0.43	a)
US224044CJ43	3.5000 % COXENT 3 1/2 08/15/27 144A	1'675	0	0	1'675 USD	96.04%	1'416'031.77	0.08	a)
US224044CL98	1.8000 % COXENT 1.8 10/01/30 144A	0	300	0	300 USD	82.42%	217'637.41	0.01	a)
US22822VAR24	3.3000 % CCI 3.3 07/01/30	2'000	0	0	2'000 USD	91.16%	1'604'907.01	0.09	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	8'500	400	0	8'900 USD	84.42%	6'613'887.77	0.38	a)
US23291KAH86	2.6000 % DHR 2.6 11/15/29	0	200	0	200 USD	90.99%	160'184.37	0.01	a)
US233851EC41	1.4500 % MBGGR 1.45 03/02/26 144A	5'000	0	0	5'000 USD	94.87%	4'175'597.91	0.24	a)
US233853AF73	2.0000 % DTRGR 2 12/14/26 144A	5'000	150	0	5'150 USD	93.66%	4'246'058.40	0.25	a)
US24422EVP14	1.5000 % DE 1 1/2 03/06/28 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	90.08%	3'964'734.03	0.23	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	5'000	200	0	5'200 USD	100.25%	4'588'560.16	0.27	a)
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	2'891	0	0	2'891 USD	69.78%	1'775'763.36	0.10	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	10'000	0	0	10'000 USD	104.67%	9'213'840.83	0.53	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	0	300	0	300 USD	102.27%	270'061.58	0.02	a)
US249670AB66	3.3750 % DEPTCC 3 3/8 PERP D	3'250	0	0	3'250 USD	93.41%	2'672'313.56	0.15	a)
US251526CB33	3.9610 % DB 3.961 11/26/25	0	400	0	400 USD	99.42%	350'043.74	0.02	a)
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	3'600	0	0	3'600 USD	86.66%	2'746'168.74	0.16	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	2'000	200	0	2'200 USD	96.02%	1'859'455.94	0.11	a)
US254687FV35	1.7500 % DIS 1 3/4 01/13/26	0	200	0	200 USD	95.80%	168'647.10	0.01	a)
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	4'118	0	4'118	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DAR08	3.9500 % WBD 3.95 03/20/28	2'000	0	0	2'000 USD	94.06%	1'655'855.88	0.10	a)
US25746UDT34	6.8750 % D 6 7/8 02/01/55 A	0	5'000	0	5'000 USD	103.64%	4'561'279.45	0.26	a)
US26442UAN46	3.4000 % DUK 3.4 04/01/32	0	200	0	200 USD	90.84%	159'925.58	0.01	a)
US26442UAP93	4.0000 % DUK 4 04/01/52	2'250	0	0	2'250 USD	78.47%	1'554'167.20	0.09	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	6'100	200	3'100	3'200 USD	97.89%	2'757'393.69	0.16	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	3'500	0	0	3'500 USD	86.82%	2'674'908.10	0.15	a)
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	2'300	0	0	2'300 USD	83.83%	1'697'261.96	0.10	a)
US28622HAA95	4.9000 % ELV 4.9 02/08/26	0	200	0	200 USD	99.86%	175'798.25	0.01	a)
US29250NAS45	5.5000 % ENBCN 5 1/2 07/15/2077	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	10'000	0	0	10'000 USD	81.51%	7'174'653.68	0.42	a)
US29274FAF18	4.0000 % ENELIM 4 10/25/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	2'000	200	0	2'200 USD	92.38%	1'788'888.06	0.10	a)
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	4'000	0	0	4'000 USD	89.22%	3'141'330.57	0.18	a)
US29444UBU97	3.9000 % EQIX 3.9 04/15/32	6'000	0	0	6'000 USD	93.20%	4'922'199.56	0.29	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	5'615	300	0	5'915 USD	94.60%	4'925'361.90	0.29	a)
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	5'000	200	0	5'200 USD	104.69%	4'791'838.05	0.28	a)
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	1'100	100	0	1'200 USD	104.74%	1'106'410.87	0.06	a)
US370334CT90	4.9500 % GIS 4.95 03/29/33	0	200	0	200 USD	99.72%	175'555.30	0.01	a)
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	2'600	200	2'600	200 USD	101.01%	177'819.30	0.01	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	101.38%	2'677'192.35	0.16	a)
US37045XEHS2	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	1'700	0	0	1'700 USD	102.71%	1'536'993.08	0.09	a)
US375558BX02	1.2000 % GILD 1.2 10/01/27	5'000	0	0	5'000 USD	90.10%	3'965'526.25	0.23	a)
US377373AH85	3.3750 % GSK 3 3/8 06/01/29	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37940XAXQ51	5.4000 % GPN 5.4 08/15/32	0	250	0	250 USD	99.99%	220'049.30	0.01	a)
US38141EC238	3.8500 % GS 3.85 07/08/24 MTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GWB66	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	10'000	0	0	10'000 USD	97.82%	8'610'517.48	0.50	a)
US38141GWQ36	3.2720 % GS 3.272 09/29/25	8'000	0	0	8'000 USD	99.61%	7'014'395.36	0.41	a)
US38141GYJ74	2.3830 % GS 2.383 07/21/32	0	200	0	200 USD	84.11%	148'075.66	0.01	a)
US404280AU33	4.2500 % HSBC 4 1/4 08/18/25	0	400	0	400 USD	98.75%	347'702.27	0.02	a)
US404280AW98	4.3000 % HSBC 4.3 03/08/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280DL07	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/02/36	3'000	2'000	0	5'000 USD	106.09%	4'669'154.09	0.27	a)
US437076CC49	3.3000 % HD 3.3 04/15/40	7'000	0	0	7'000 USD	80.09%	4'934'883.96	0.29	a)
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	1'750	0	0	1'750 USD	94.94%	1'462'552.98	0.08	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	3'300	0	0	3'300 USD	89.71%	2'605'773.27	0.15	a)
US44891CCB72	5.5000 % HYNMTR 5 1/2 03/30/26 REGS	0	200	0	200 USD	100.65%	177'190.80	0.01	a)
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	3'550	0	0	3'550 USD	104.06%	3'251'789.18	0.19	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	3'000	0	0	3'000 USD	99.55%	2'628'813.81	0.15	a)
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	86.43%	4'564'747.64	0.26	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	3'550	0	0	3'550 USD	97.71%	3'053'421.32	0.18	a)
US456837BL64	5.3350 % INTNED 5.335 03/19/30	0	450	0	450 USD	101.33%	401'392.68	0.02	a)
US458140CA64	4.1500 % INTC 4.15 08/05/32	8'000	200	0	8'200 USD	95.84%	6'917'851.30	0.40	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	3'900	0	0	3'900 USD	92.53%	3'176'428.78	0.18	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	6'000	0	0	6'000 USD	96.14%	5'077'792.55	0.29	a)
US46625HRX07	3.6250 % JPM 3 5/8 12/01/27	0	300	0	300 USD	96.94%	255'994.31	0.01	a)
US46647PAF36	3.5400 % JPM 3.54 05/01/28	8'000	0	0	8'000 USD	96.57%	6'800'670.66	0.39	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	90.36%	2'386'128.89	0.14	a)
US46647PBP09	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	0	7'400	3'000	4'400 USD	89.13%	3'451'900.38	0.20	a)
US46647PBP09XXX	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	5'000	0	0	5'000 USD	76.61%	3'371'841.64	0.20	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	4'500	0	4'500 USD	87.09%	3'449'743.76	0.20	a)
US46647PCU84XXX	2.9630 % *RETIRED*	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	8'000	0	0	8'000 USD	101.83%	7'170'798.18	0.42	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	5'000	0	0	5'000 USD	82.68%	3'638'777.45	0.21	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	5'100	300	0	5'400 USD	84.67%	4'024'423.78	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	650	200	0	850 USD	101.54%	759'720.01	0.04	a)
US49456BAR24	2.0000 % KMI 2 02/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	83.83%	3'689'611.89	0.21	a)
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	15'000	0	0	15'000 USD	83.93%	11'081'907.38	0.64	a)
US50077LBC90	3.8750 % KHC 3 7/8 05/15/27	0	300	0	300 USD	97.98%	258'740.69	0.01	a)
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	5'000	0	0	5'000 USD	59.94%	2'638'241.29	0.15	a)
US53944YAF07	4.4500 % LLOYDS 4.45 05/08/25	10'000	0	5'000	5'000 USD	99.36%	4'373'126.01	0.25	a)
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'400	0	0	4'400 USD	80.45%	3'115'754.03	0.18	a)
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	10'000	300	0	10'300 USD	88.52%	8'025'641.52	0.46	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	5'000	200	0	5'200 USD	93.99%	4'302'066.95	0.25	a)
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	3'800	200	0	4'000 USD	101.38%	3'569'448.96	0.21	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	10'000	0	0	10'000 USD	78.52%	6'912'075.10	0.40	a)
US57636QAM69	2.9500 % MA 2.95 06/01/29	0	200	0	200 USD	93.93%	165'360.24	0.01	a)
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	87.62%	3'856'155.19	0.22	a)
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	3'450	350	0	3'800 USD	94.86%	3'173'019.57	0.18	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	1'700	100	1'700	100 USD	99.08%	87'215.17	0.01	a)
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	8'000	0	0	8'000 USD	70.10%	4'936'512.42	0.29	a)
US58933YBM66	5.0000 % MRK 5 05/17/53	1'300	0	0	1'300 USD	95.87%	1'097'018.60	0.06	a)
US59156RBZ01	4.5500 % MET 4.55 03/23/30	5'000	0	0	5'000 USD	100.21%	4'410'492.63	0.26	a)
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	2'100	0	0	2'100 USD	98.45%	1'819'798.92	0.11	a)
US59217HBM88	3.0000 % MET 3 09/19/27 REGS	0	400	0	400 USD	95.09%	334'825.97	0.02	a)
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	13'722	0	3'722	10'000 USD	65.01%	5'722'329.20	0.33	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	11'278	0	6'278	5'000 USD	70.15%	3'087'476.88	0.18	a)
US595112B519	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	5'000	200	0	5'200 USD	84.90%	3'886'036.15	0.23	a)
US606822AD62	3.8500 % MUFG 3.85 03/01/26	0	400	0	400 USD	98.34%	346'244.58	0.02	a)
US606822CN27	5.3540 % MUFG 5.354 09/13/28	5'000	0	0	5'000 USD	101.45%	4'464'936.09	0.26	a)
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	2'200	0	0	2'200 USD	108.50%	2'101'098.65	0.12	a)
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	8'000	0	0	8'000 USD	97.65%	6'876'724.26	0.40	a)
US61747YEK73	2.4750 % MS 2.475 01/21/28	8'000	0	0	8'000 USD	94.27%	6'638'141.30	0.38	a)
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	0	500	0	500 USD	97.54%	429'289.12	0.02	a)
US61772BAC72	3.2170 % MS 3.217 04/22/42	8'000	0	0	8'000 USD	76.99%	5'421'706.22	0.31	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	8'000	200	0	8'200 USD	85.58%	6'177'279.37	0.36	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	2'700	0	0	2'700 USD	99.33%	2'360'703.74	0.14	a)
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	4'000	0	0	4'000 USD	102.48%	3'608'285.59	0.21	a)
US637639AB13	1.5000 % NSCCLF 1 1/2 04/23/25 144A	5'000	250	0	5'250 USD	97.34%	4'498'246.95	0.26	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	2'000	0	0	2'000 USD	93.80%	1'651'313.79	0.10	a)
US641062AS38	1.0000 % NESNVX 1 09/15/27 144A	5'000	0	0	5'000 USD	89.88%	3'955'667.45	0.23	a)
US64110LAV80	4.8750 % NFLX 4 7/8 06/15/30 144A	0	5'000	0	5'000 USD	101.09%	4'449'047.58	0.26	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	6'000	300	0	6'300 USD	100.72%	5'585'281.32	0.32	a)
US64952XCS80	3.0000 % NYLIFE 3 01/10/28 REGS	7'850	0	0	7'850 USD	94.65%	6'540'141.31	0.38	a)
US65163LAN91	5.3000 % NEM 5.3 03/15/26 144A	0	3'025	0	3'025 USD	100.54%	2'677'215.02	0.16	a)
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	87.15%	3'835'601.35	0.22	a)
US65339KCB44	3.8000 % NEE 3.8 03/15/2082	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	15'000	0	0	15'000 USD	79.93%	10'554'153.49	0.61	a)
US65535HBR93	5.5940 % NOMURA 5.594 07/02/27	0	850	0	850 USD	101.47%	759'188.78	0.04	a)
US67066GAE44	3.2000 % NVDA 3.2 09/16/26	0	200	0	200 USD	97.56%	171'745.58	0.01	a)
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	5'000	0	0	5'000 USD	92.62%	4'076'393.74	0.24	a)
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	300	0	300 USD	100.27%	264'788.00	0.02	a)
US674599EF81	6.1250 % OXY 6 1/8 01/01/31	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XBE40	3.9000 % ORCL 3.9 05/15/35	12'000	0	0	12'000 USD	88.90%	9'390'084.48	0.54	a)
US68389XBU81	2.8000 % ORCL 2.8 04/01/27	0	300	0	300 USD	95.13%	251'214.55	0.01	a)
US6944PM2E61	1.4500 % PACLIF 1.45 01/20/28 REGS	10'000	400	0	10'400 USD	89.59%	8'201'239.96	0.47	a)
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	10'000	0	0	10'000 USD	65.84%	5'795'830.08	0.34	a)
US71427QAA67	1.2500 % RIFP 1 1/4 04/01/28 144A	8'000	0	0	8'000 USD	88.52%	6'233'578.40	0.36	a)
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	6'000	0	0	6'000 USD	98.83%	5'219'917.71	0.30	a)
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	8'500	400	0	8'900 USD	94.32%	7'389'162.68	0.43	a)
US74340XCB55	2.2500 % PLD 2 1/4 01/15/32	3'000	150	0	3'150 USD	83.71%	2'321'128.14	0.13	a)
US744320AY89	3.9050 % PRU 3.905 12/07/47	7'753	0	0	7'753 USD	79.60%	5'432'227.80	0.31	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	6'000	400	0	6'400 USD	87.74%	4'942'695.30	0.29	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	6'800	300	0	7'100 USD	88.50%	5'530'925.88	0.32	a)
US747525BP77	1.6500 % QCOM 1.65 05/20/32	5'071	0	0	5'071 USD	80.72%	3'602'914.00	0.21	a)
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	4'000	0	0	4'000 USD	99.32%	3'497'021.99	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US771196BW19	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 144A	0	200	0	200 USD	89.94%	158'332.33	0.01	a)
US775109BB60	5.0000 % RCICN 5 03/15/44	5'000	0	0	5'000 USD	91.66%	4'034'273.78	0.23	a)
US78016HZS20	5.2000 % RY 5.2 08/01/28 GMTN	0	200	0	200 USD	102.24%	179'991.76	0.01	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	5'000	300	0	5'300 USD	85.42%	3'985'120.62	0.23	a)
US78081BAM54	3.5500 % RPRX 3.55 09/02/50	8'000	0	0	8'000 USD	69.27%	4'877'782.14	0.28	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	4'400	400	0	4'800 USD	101.64%	4'294'324.27	0.25	a)
US79466LAF13	3.7000 % CRM 3.7 04/11/28	0	100	0	100 USD	97.81%	86'097.25	0.00	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	2'200	0	0	2'200 USD	89.45%	1'732'263.34	0.10	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	4'700	0	4'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US817826AD20	1.3000 % SVELEV 1.3 02/10/28 144A	4'000	250	0	4'250 USD	88.78%	3'321'277.88	0.19	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	10'000	0	7'000	3'000 USD	98.36%	2'597'494.52	0.15	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	5'900	400	0	6'300 USD	102.99%	5'711'554.06	0.33	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	2'550	0	0	2'550 USD	98.31%	2'206'792.91	0.13	a)
US852234AN39	2.7500 % SQ 2 3/4 06/01/26	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244AK58	2.4500 % SBUX 2.45 06/15/26	0	200	0	200 USD	95.98%	168'965.75	0.01	a)
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	6'000	0	0	6'000 USD	71.77%	3'790'479.74	0.22	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	2'500	200	0	2'700 USD	103.44%	2'458'313.79	0.14	a)
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	3'000	0	0	3'000 USD	101.05%	2'668'398.65	0.15	a)
US86964WAK80	3.1250 % SUZANO 3 1/8 01/15/32 DM3N	3'000	0	0	3'000 USD	83.16%	2'195'915.66	0.13	a)
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	5'000	0	0	5'000 USD	69.45%	3'056'712.14	0.18	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	5'000	0	0	5'000 USD	91.81%	4'040'919.66	0.23	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	8'000	500	0	8'500 USD	86.81%	6'495'157.89	0.38	a)
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	4'900	0	0	4'900 USD	85.69%	3'696'175.03	0.21	a)
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	86.66%	3'813'991.21	0.22	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	5'550	300	0	5'850 USD	86.34%	4'445'839.94	0.26	a)
US89114QCA40	2.6500 % TD 2.65 06/12/24 MTN	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US891160MJ94	3.6250 % TD 3 5/8 09/15/31	2'000	0	0	2'000 USD	96.47%	1'698'371.96	0.10	a)
US90352JAC71	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 144A	0	300	0	300 USD	97.28%	256'878.96	0.01	a)
US91324PCP53	3.7500 % UNH 3 3/4 07/15/25	0	300	0	300 USD	98.84%	261'014.37	0.02	a)
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	14'000	0	0	14'000 USD	82.71%	10'192'150.68	0.59	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	2'666	400	3'066	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	5'000	0	0	5'000 USD	96.63%	4'252'707.81	0.25	a)
US92343VFW90	2.9870 % VZ 2.987 10/30/56	5'000	0	0	5'000 USD	63.04%	2'774'371.95	0.16	a)
US92343VGK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	10'000	0	0	10'000 USD	78.40%	6'901'512.10	0.40	a)
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	5'000	0	0	5'000 USD	71.91%	3'164'894.86	0.18	a)
US92556VAD82	2.7000 % VTRS 2.7 06/22/30	0	500	0	500 USD	86.98%	382'803.12	0.02	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	20'000	0	0	20'000 USD	69.94%	12'312'937.00	0.71	a)
US92826CAD48	3.1500 % V 3.15 12/14/25	0	300	0	300 USD	97.99%	258'756.53	0.01	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000	0	0	10'000 USD	89.36%	7'865'561.90	0.46	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92857WBU36	4.2500 % VOD 4 1/4 09/17/50	5'000	0	0	5'000 USD	80.56%	3'545'823.05	0.21	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	4'000	100	0	4'100 USD	88.88%	3'207'665.33	0.19	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	3'300	0	0	3'300 USD	90.00%	2'614'313.45	0.15	a)
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'600	0	0	2'600 USD	96.31%	2'204'221.70	0.13	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	2'100	100	0	2'200 USD	102.29%	1'980'877.63	0.11	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	2'200	200	2'000	400 USD	104.32%	367'296.64	0.02	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	4'200	300	0	4'500 USD	106.35%	4'212'696.05	0.24	a)
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	2'500	0	0	2'500 USD	92.06%	2'025'961.39	0.12	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	5'000	2'250	0	7'250 USD	102.84%	6'562'736.88	0.38	a)
USF11494CE30	5.2810 % BPCEGP 5.281 05/30/29 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	101.43%	1'339'282.77	0.08	a)
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	3'000	0	0	3'000 USD	82.51%	2'178'856.42	0.13	a)
USF8500RAA08	5.3750 % SOCGEN 5 3/8 PERP REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF8500RAB80	4.7500 % SOCGEN 4 3/4 PERP REGS	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF8500RAC63	9.3750 % SOCGEN 9 3/8 PERP REGS	0	3'000	0	3'000 USD	102.65%	2'710'729.88	0.16	a)
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	6'500	0	0	6'500 USD	97.19%	5'560'618.47	0.32	a)
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	3'800	200	0	4'000 USD	100.69%	3'545'224.48	0.21	a)
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	4'900	0	0	4'900 USD	92.40%	3'985'376.77	0.23	a)
USG7420TAD84	2.7500 % RKTLN 2 3/4 06/26/24 REGS	4'000	400	4'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG91139AE82	1.3750 % TAISEM 1 3/8 09/28/30 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	82.88%	3'647'932.05	0.21	a)
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	8'800	200	0	9'000 USD	94.13%	7'457'134.70	0.43	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	3'800	0	0	3'800 USD	82.43%	2'757'242.29	0.16	a)
USH42097CZ86	4.4880 % UBS 4.488 05/12/26 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	99.28%	1'398'203.18	0.08	a)
USH42097ES26	9.2500 % UBS 9 1/4 PERP REGS	300	0	0	300 USD	108.49%	286'497.61	0.02	a)
USH4209UAT37	7.0000 % UBS 7 PERP REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAJ36	4.2390 % NTT 4.239 07/25/25 REGS	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAN48	5.1360 % NTT 5.136 07/02/31 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	101.64%	5'368'063.79	0.31	a)
USJ7771YSA66	5.5000 % SUMITR 5 1/2 03/09/28 REGS	1'400	200	0	1'600 USD	102.68%	1'446'131.04	0.08	a)
USN27915AB85	4.8750 % DT 4 7/8 03/06/42 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	93.05%	1'638'198.07	0.09	a)
USN30707AP36	4.6250 % ENELIM 4 5/8 06/15/27 REGS	0	300	0	300 USD	99.18%	261'899.02	0.02	a)
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	0	300	0	300 USD	96.51%	254'845.58	0.01	a)
USN82008AX66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 REGS	5'000	300	0	5'300 USD	94.73%	4'419'509.03	0.26	a)
USP01703AC49	4.2500 % ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	93.73%	4'125'159.59	0.24	a)
USPOR80BAG79	5.3750 % SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS	3'450	200	0	3'650 USD	94.86%	3'047'672.41	0.18	a)
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	700	0	700 USD	102.66%	632'577.58	0.04	a)
USP71340AD81	3.6250 % TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS	0	200	0	200 USD	79.22%	139'470.33	0.01	a)
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	6'000	2'000	0	8'000 USD	83.96%	5'912'111.10	0.34	a)
USQ0426YAY97	5.8980 % ANZ 5.898 07/10/34 REGS	0	6'000	0	6'000 USD	101.89%	5'381'320.35	0.31	a)
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	0	200	0	200 USD	95.79%	168'640.06	0.01	a)
USU01386AE82	5.3750 % ALC5W 5 3/8 12/06/32 REGS	800	0	0	800 USD	102.45%	721'466.98	0.04	a)
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'956	0	0	1'956 USD	88.39%	1'521'923.27	0.09	a)
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	12'000	0	0	12'000 USD	87.37%	9'228'681.84	0.53	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	9'500	0	0	9'500 USD	63.37%	5'299'404.29	0.31	a)
USU9841MAA00	1.5000 % WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	93.87%	4'131'541.40	0.24	a)
USX10001AA78	3.5000 % ALVGR 3 1/2 PERP REGS	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	6'000	4'000	0	10'000 USD	84.40%	7'429'398.03	0.43	a)
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	4'000	200	0	4'200 USD	94.30%	3'486'170.27	0.20	a)
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	107.32%	4'723'509.53	0.27	a)
USY555CGAL65	5.3750 % LGENSO 5 3/8 07/02/29 REGS	0	3'800	0	3'800 USD	101.04%	3'379'570.23	0.20	a)
USY8085FBD16	2.3750 % HYUELE 2 3/8 01/19/31 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	84.51%	2'603'616.65	0.15	a)
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	98.58%	4'338'840.28	0.25	a)
XS1395052639	4.0500 % STANLN 4.05 04/12/26 REGS	0	200	0	200 USD	98.37%	173'182.15	0.01	a)
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	98.77%	4'347'070.61	0.25	a)
XS1650033571	5.0000 % BOAD 5 07/27/27 REGS	4'000	100	0	4'100 USD	96.07%	3'467'009.87	0.20	a)
XS1681539539	4.1250 % STOAU 4 1/8 09/14/27 EMTN	1'200	200	0	1'400 USD	97.04%	1'195'872.44	0.07	a)
XS2075280995	4.8750 % DNBNO 4 7/8 PERP	7'200	0	5'000	2'200 USD	99.23%	1'921'716.03	0.11	a)
XS2283175516	1.4560 % STANLN 1.456 01/14/27 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	94.53%	4'160'369.59	0.24	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	10'000	0	0	10'000 USD	84.83%	7'467'512.85	0.43	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	14'300	300	0	14'600 USD	90.07%	11'575'352.64	0.67	a)
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	5'900	0	5'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2532384372	6.2530 % BKIR 6.253 09/16/26 REGS	0	200	0	200 USD	100.94%	177'696.07	0.01	a)
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	6'000	0	0	6'000 USD	101.66%	5'368'961.64	0.31	a)
USD							1'068'800'846.02	61.89	

Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

96'730'186.62 5.60

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

96'730'186.62 5.60

LU2368700907	SWC (LU) BF RESP. CORPORATE HYBRID STH CHF	1'002	0	0	1'002 CHF	96'498.59	96'730'186.62	5.60	a)
--------------	--	-------	---	---	-----------	-----------	---------------	------	----

CHF 96'730'186.62 5.60

Derivative Finanzinstrumente

12'707'700.22 0.74

Futures

0.00 0.00

03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	-100	120	20	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	300	300	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO-BUND FUTURE SEP24	0	100	200	-100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
09/24	US 10YR NOTE (CBT)SEP24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Devisentermingeschäfte									
	EUR/CHF Verfall 22.02.2024		226'742'640	240'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2024		561'582'596	652'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.02.2024		15'000'000	12'880'785		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 21.03.2024		11'597'843	1'970'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 21.03.2024		219'211'525	235'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 21.03.2024		54'032'650	50'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 21.03.2024		44'385'040	70'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 21.03.2024		9'612'650	17'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2024		517'213'290	605'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.03.2024		1'000'000'000	5'927'910		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		225'945'776	238'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		547'950'624	624'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.05.2024		9'804'580	17'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.05.2024		57'218'073	51'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.05.2024		45'619'630	70'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.05.2024		216'201'825	225'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.05.2024		5'452'720	920'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.05.2024		530'206'800	600'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		10'000'000	9'010'150		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		8'000'000	7'820'032		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		12'000'000	11'675'988		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		30'000'000	27'320'130		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		11'000'000	10'735'604		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 16.05.2024		8'000'000	7'814'344		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2024		10'000'000	9'104'670		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 20.06.2024		227'917'805	235'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.06.2024		558'463'140	620'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.07.2024		5'350'527	920'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.07.2024		10'130'861	17'000'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		488'827'605	543'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.07.2024		179'253'168	184'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.07.2024		46'131'540	70'000'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.07.2024		57'645'147	51'000'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		18'025'640	20'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2024		18'069'200	20'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 29.08.2024		218'469'640	230'000'000		CHF/EUR	-169'250.47	-0.01	b)
	USD/CHF Verfall 29.08.2024		560'048'410	635'000'000		CHF/USD	2'947'510.92	0.17	b)
	CHF/EUR Verfall 29.08.2024		4'000'000	3'810'776		EUR/CHF	-8'350.38	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 26.09.2024		5'261'922	920'000'000		CHF/JPY	-128'912.55	-0.01	b)
	CAD/CHF Verfall 26.09.2024		45'648'172	71'000'000		CHF/CAD	629'519.45	0.04	b)
	GBP/CHF Verfall 26.09.2024		58'260'258	51'000'000		CHF/GBP	949'268.57	0.05	b)
	EUR/CHF Verfall 26.09.2024		177'338'464	184'000'000		CHF/EUR	2'758'378.75	0.16	b)
	AUD/CHF Verfall 26.09.2024		9'967'066	17'000'000		CHF/AUD	245'074.83	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 26.09.2024		524'940'372	594'000'000		CHF/USD	5'484'461.10	0.32	b)
Devisentermingeschäfte							12'707'700.22	0.74	

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		22'248'423.21	1.29
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		1'575'787'244.71	91.25
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		96'730'186.62	5.60
Derivative Finanzinstrumente		12'707'700.22	0.74
Sonstige Vermögenswerte		19'378'098.34	1.12
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'726'851'653.10	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-285'947.33	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'726'565'705.77	

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);	1'672'517'431.33	96.85
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	12'707'700.22	0.74
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.07.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
Ausgeliehene Effekten				173'799'871.45	10.06
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				173'799'871.45	10.06
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	2'800 AUD	99.79%	1'606'004.88	0.09
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	1'000 EUR	90.74%	864'295.33	0.05
DE000A289FK7	2.6250 % ALVGR 2 5/8 PERP	1'000 EUR	80.71%	768'757.82	0.04
DE000A30VT97	10.0000 % DB 10 PERP	1'800 EUR	109.14%	1'871'273.97	0.11
DE000DL19WG7	6.7500 % DB 6 3/4 PERP	1'000 EUR	96.75%	921'560.68	0.05
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	1'500 EUR	99.04%	1'415'074.29	0.08
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	1'000 EUR	94.52%	900'338.59	0.05
FR0014002RQ0	4.8750 % CNPFP 4 7/8 PERP	1'000 USD	85.64%	753'802.09	0.04
FR00140046Y4	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 PERP	1'000 EUR	83.88%	799'009.78	0.05
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	6'000 EUR	103.83%	5'933'993.52	0.34
FR001400XS4	4.5000 % ORAFP 4 1/2 PERP	1'000 EUR	100.52%	957'470.59	0.06
FR001400Q7G7	5.8680 % ALOFP 5.868 PERP	700 EUR	104.36%	695'826.42	0.04
US022095BM44	3.4000 % MO 3.4 02/04/41	1'000 USD	74.32%	654'201.80	0.04
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	3'800 USD	74.53%	2'493'024.68	0.14
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	2'200 USD	103.95%	2'013'024.36	0.12
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	1'800 USD	96.95%	1'536'155.96	0.09
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	15'000 USD	80.18%	10'586'502.68	0.61
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	1'000 USD	101.92%	897'106.79	0.05
US05971KAG40	2.7490 % SANTAN 2.749 12/03/30	4'000 USD	85.44%	3'008'448.03	0.17
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	3'260 USD	86.43%	2'480'265.64	0.14
US06675FAZ09	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 144A	1'300 USD	99.88%	1'142'986.14	0.07
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	7'400 USD	88.14%	5'741'437.67	0.33
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	500 USD	90.51%	398'348.34	0.02
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	680 USD	69.78%	417'682.15	0.02
US251526CF47	3.7290 % DB 3.729 01/14/32	1'500 USD	86.66%	1'144'236.98	0.07
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	700 USD	81.51%	502'225.76	0.03
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	1'000 USD	104.74%	922'009.06	0.05
US38141GWB66	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	200 USD	97.82%	172'210.35	0.01
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	1'000 USD	104.06%	915'996.95	0.05
US456837AY94	3.8750 % INTNED 3 7/8 PERP	1'000 USD	86.43%	760'791.27	0.04
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	4'300 USD	96.14%	3'639'084.66	0.21
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	1'000 USD	90.36%	795'376.30	0.05
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	15'000 USD	83.93%	11'081'907.38	0.64
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	900 USD	70.10%	555'357.65	0.03
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	10'000 USD	65.01%	5'722'329.20	0.33
US606822DD36	8.2000 % MUFG 8.2 PERP	1'400 USD	108.50%	1'337'062.78	0.08
US65535HBR93	5.5940 % NOMURA 5.594 07/02/27	850 USD	101.47%	759'188.78	0.04
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	200 USD	92.62%	163'055.75	0.01
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	400 USD	98.36%	346'332.60	0.02
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	3'200 USD	102.99%	2'901'106.82	0.17
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	2'250 USD	98.31%	1'947'170.22	0.11
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	1'000 USD	71.77%	631'746.62	0.04
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	2'500 USD	103.44%	2'276'216.47	0.13
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	14'000 USD	82.71%	10'192'150.68	0.59
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	4'450 USD	96.63%	3'784'909.95	0.22
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	10'000 USD	89.36%	7'865'561.90	0.46
US96122UAA25	5.0000 % WSTP 5 PERP	2'300 USD	96.31%	1'949'888.43	0.11
USF1067PAB25	4.6250 % BNP 4 5/8 PERP REGS	1'000 USD	92.06%	810'384.56	0.05
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	2'750 USD	102.84%	2'489'313.99	0.14
USF1R15XL274	4.5000 % BNP 4 1/2 PERP REGS	2'900 USD	82.51%	2'106'227.87	0.12
USF8500RAC63	9.3750 % SOCGEN 9 3/8 PERP REGS	3'000 USD	102.65%	2'710'729.88	0.16
USG0446NAN42	4.0000 % AALLN 4 09/11/27 REGS	3'700 USD	97.19%	3'165'275.13	0.18
USG0706JAA63	5.2500 % BACARD 5 1/4 01/15/29 REGS	200 USD	100.69%	177'261.22	0.01
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	1'000 USD	92.40%	813'342.20	0.05
USG91139AF57	1.2500 % TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS	5'000 USD	94.13%	4'142'852.61	0.24
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	600 USD	82.43%	435'354.05	0.03

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.07.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	700 USD	102.66%	632'577.58	0.04	
USQ0426RNF11	2.5700 % ANZ 2.57 11/25/35 REGS	742 USD	83.96%	548'348.30	0.03	
USU01386AE82	5.3750 % ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS	500 USD	102.45%	450'916.87	0.03	
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	100 USD	88.39%	77'807.94	0.00	
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	2'100 USD	87.37%	1'615'019.32	0.09	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	1'000 USD	63.37%	557'832.03	0.03	
USX10001AB51	3.2000 % ALVGR 3.2 PERP REGS	1'000 USD	84.40%	742'939.80	0.04	
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	1'100 USD	107.32%	1'039'172.10	0.06	
XS1550938978	5.1250 % AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN	5'000 USD	98.77%	4'347'070.61	0.25	
XS1693822634	4.7500 % ABNANV 4 3/4 PERP	1'000 EUR	94.93%	904'234.39	0.05	
XS1700709683	4.6250 % ASRND 4 5/8 PERP	1'000 EUR	94.32%	898'395.46	0.05	
XS2010028343	2.8750 % SESGFP 2 7/8 PERP	4'000 EUR	95.11%	3'623'605.17	0.21	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	1'900 EUR	99.27%	1'796'571.83	0.10	
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	1'000 EUR	93.59%	891'470.65	0.05	
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	1'500 EUR	96.13%	1'373'411.17	0.08	
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	2'200 EUR	87.79%	1'839'715.16	0.11	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	2'000 EUR	81.44%	1'551'441.45	0.09	
XS2247549731	1.7500 % CLNXSM 1 3/4 10/23/30 EMTN	5'000 EUR	89.77%	4'275'279.55	0.25	
XS2362994068	2.2500 % TNEMAK 2 1/4 07/20/28 REGS	1'000 EUR	87.57%	834'071.95	0.05	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	500 EUR	91.51%	435'800.57	0.03	
XS2388378981	3.6250 % SANTAN 3 5/8 PERP	1'000 EUR	84.09%	800'933.87	0.05	
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	3'900 USD	90.07%	3'092'046.25	0.18	
XS2410367747	2.8800 % TELEFO 2.88 PERP	1'300 EUR	94.37%	1'168'533.23	0.07	
XS2462605671	7.1250 % TELEFO 7 1/8 PERP	2'200 EUR	108.89%	2'281'894.74	0.13	
XS2585240984	7.5000 % INTNED 7 1/2 PERP	4'982 USD	101.66%	4'458'027.82	0.26	
XS2595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	1'500 EUR	104.55%	1'493'728.42	0.09	
XS2602037629	6.3750 % NNGRNV 6 3/8 PERP	1'000 EUR	101.65%	968'262.61	0.06	
XS2711801287	7.1250 % APAAU 7 1/8 11/09/2083 EMTN	200 EUR	108.28%	206'277.19	0.01	
XS2737652474	6.3750 % AXASA 6 3/8 PERP EMTN	2'000 EUR	103.67%	1'974'987.89	0.11	
XS2776511730	3.6250 % BKNG 3 5/8 03/01/32	2'930 EUR	101.98%	2'846'247.26	0.16	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57480325
CAD	1 = CHF	0.63719280
EUR	1 = CHF	0.95251750
GBP	1 = CHF	1.13063711
JPY	100 = CHF	0.58503900
USD	1 = CHF	0.88025000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	3'837'361.50	1.892
Bond	CHF	197'444'787.92	97.337
Equity	CHF	1'565'242.38	0.772
Total	CHF	202'847'391.80	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % (29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	1'608'092'429.39	93.138
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	-	-
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	173'799'871.45
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	1.050	1.200	0.850	0.200	4.000
BA CHF	0.630	0.900	0.430	0.200	4.000
CT CHF	0.570	0.750	0.370	0.200	4.000
DA CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
DT CHF	0.500	0.700	0.400	0.100	4.000
GT CHF	0.400	0.600	0.300	0.100	4.000
MT CHF	-	-	-	-	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

9 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

10 TER

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

11 Fussnoten

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

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend

hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zu-zurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.