

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE GLOBAL AGGREGATE

Halbjahresbericht per 30.04.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Investment Fund I
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	56317906	CHF
GT CHF	37165093	CHF
GTH1 CHF	55641033	CHF
MT CHF	51788899	CHF
NT CHF	3929949	CHF
NTH1 CHF	50718466	CHF
Swiss Red Cross	51196143	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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	27
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	27
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	28
7	Pauschale Verwaltungskommission	28
8	Benchmark	28
9	TER	28
10	Fussnoten	29
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	30

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	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	30.04.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'086'018'230.59	1'005'734'992.77	555'463'493.54	481'962'050.16
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		327'840.85	312'910.49	347'532.07	17'722.90
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'041.895	4'124.042	181.241
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.1107	77.4168	84.2698	97.7864
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.1593	77.4710	84.4046	97.8450
Thesaurierung je Anteil		-	0.88	0.88	0.95
Total Expense Ratio (TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'674'873.49	10'076'863.08	9'681'775.34	14'095'093.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		87'520.660	120'411.940	106'347.351	133'504.311
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.6921	83.6866	91.0392	105.5778
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		87.7448	83.7452	91.1848	105.6412
Thesaurierung je Anteil		-	1.04	1.05	1.15
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'438'187.14	23'580'947.40	114'019'753.23	120'816'266.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		116'039.400	296'761.300	1'380'846.600	1'248'562.500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.3361	79.4610	82.5724	96.7643
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.3849	79.5166	82.7045	96.8224
Thesaurierung je Anteil		-	0.99	0.96	1.05
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse MT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'179.95	7'801.94	8'466.51	9'793.32
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000	100.000	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.7995	78.0194	84.6651	97.9332
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		81.8486	78.0740	84.8006	97.9920
Thesaurierung je Anteil		-	1.29	1.34	1.45
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		744'474'802.31	688'038'351.48	173'299'082.85	143'953'372.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		803'764.872	778'834.784	180'766.822	129'811.681
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		926.2346	883.4202	958.6886	1'108.9401
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		926.7903	884.0386	960.2225	1'109.6054
Thesaurierung je Anteil		-	14.67	15.28	16.58
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse NTH1 CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	299'124'472.33	259'310'603.04	230'454'318.61	170'209'966.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	3'523'062.051	3'126'049.327	2'687'892.858	1'698'150.997
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	84.9047	82.9515	85.7379	100.2325
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	84.9556	83.0096	85.8751	100.2927
Thesaurierung je Anteil	-	1.38	1.37	1.49
Total Expense Ratio (TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse Swiss Red Cross	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	24'969'874.52	24'407'515.34	27'652'564.93	32'859'835.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	321'552.338	327'248.144	337'797.274	343'467.199
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	77.6542	74.5841	81.8614	95.6710
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	77.7007	74.6363	81.9924	95.7284
Ausschüttung je Anteil	-	0.70	0.80	0.80
Total Expense Ratio (TER)	0.70 %	0.70 %	0.70 %	0.70 %

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 DT CHF	5.18 %	-4.42 %	-14.68 %	-12.79 %
Klasse GT CHF	5.23 %	-4.33 %	-14.59 %	-12.71 %
Klasse GTH1 CHF	2.79 %	1.66 %	-13.53 %	-14.17 %
Klasse MT CHF	5.43 %	-3.88 %	-14.25 %	-12.28 %
Klasse NT CHF	5.44 %	-3.94 %	-14.25 %	-12.42 %
Klasse NTH1 CHF	2.93 %	2.19 %	-13.02 %	-13.89 %
Klasse Swiss Red Cross	5.06 %	-4.55 %	-14.85 %	-12.79 %
Benchmark Hedge	2.71 %	2.52 %	-	-
Benchmark	5.24 %	-3.83 %	-14.96 %	-1.77 %
Tracking Error 33)	-	0.48 %	1.15 %	0.43 %

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.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DT CHF	-0.06 %
Klasse GT CHF	-0.01 %
Klasse GTH1 CHF	0.08 %
Klasse MT CHF	0.19 %
Klasse NT CHF	0.20 %
Klasse NTH1 CHF	0.22 %
Klasse Swiss Red Cross	-0.18 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.04.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	77'789'022.41	115'492'262.59
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'012'968'461.37	923'722'696.96
Derivative Finanzinstrumente	-10'800'269.33	-16'854'030.06
Sonstige Vermögenswerte	7'901'772.53	7'147'517.71
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'087'858'986.98	1'029'508'447.20
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'818'071.85	-23'745'397.69
Andere Verbindlichkeiten	-22'684.54	-28'056.74
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'086'018'230.59	1'005'734'992.77

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'041.895	4'124.042
Ausgegebene Anteile		-	17.744
Zurückgenommene Anteile		-	-99.891
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'041.895	4'041.895

Klasse GT CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		120'411.940	106'347.351
Ausgegebene Anteile		3'134.848	31'169.832
Zurückgenommene Anteile		-36'026.128	-17'105.243
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		87'520.660	120'411.940

Klasse GTH1 CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		296'761.300	1'380'846.600
Ausgegebene Anteile		38'332.300	224'764.100
Zurückgenommene Anteile		-219'054.200	-1'308'849.400
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		116'039.400	296'761.300

Klasse MT CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		100.000	100.000

Klasse NT CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		778'834.784	180'766.822
Ausgegebene Anteile		85'668.308	633'914.962
Zurückgenommene Anteile		-60'738.220	-35'847.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		803'764.872	778'834.784

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'126'049.327	2'687'892.858
Ausgegebene Anteile		1'424'819.837	1'016'698.809
Zurückgenommene Anteile		-1'027'807.113	-578'542.340
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'523'062.051	3'126'049.327

Klasse Swiss Red Cross	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		327'248.144	337'797.274
Ausgegebene Anteile		702.000	2'119.337
Zurückgenommene Anteile		-6'397.806	-12'668.467
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		321'552.338	327'248.144

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'005'734'992.77	555'463'493.54
Ausbezahlte Ausschüttung		-227'516.18	-268'887.28
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'899'187.88	-5'174'003.63
Saldo aus dem Anteilverkehr		37'730'806.15	516'976'238.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		48'679'135.73	-61'261'848.65
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'086'018'230.59	1'005'734'992.77

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		149'408.45	133'365.60
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-147'152.19	-341'695.59
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'192'573.43	15'541'583.62
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'224'496.95	1'771'420.98
Total Ertrag		14'419'326.64	17'104'674.61
Aufwand			
Passivzinsen		-369.87	-2'545.10
Reglementarische Vergütungen		-145'585.41	-319'781.38
Sonstige Aufwendungen		-1.60	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'173'963.61	-381'185.21
Total Aufwand		-1'319'920.49	-703'511.69
Nettoertrag / Verlust		13'099'406.15	16'401'162.92
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-27'602'359.74	-53'513'519.58
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		148'444.13	944'833.62
Realisierter Erfolg		-14'354'509.46	-36'167'523.04
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		63'033'645.19	-25'094'325.61
Gesamterfolg		48'679'135.73	-61'261'848.65

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'012'968'461.37	93.12	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'012'968'461.37	93.12	
X52466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	94.42%	1'851'853.96	0.17	a)
AE							1'851'853.96	0.17	
US676167BX63	3.1250 % OKB 3 1/8 11/07/23	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	6'500	0	0	6'500 AUD	77.57%	3'002'954.53	0.28	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	3'750	4'750	0	8'500 AUD	97.85%	4'953'551.95	0.46	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	2'000	0	0	2'000 AUD	54.47%	648'829.37	0.06	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	500	0	0	500 AUD	93.34%	277'946.79	0.03	a)
AU3CB0272888	1.6000 % SGTOPT 1.6 07/01/25 MTN	500	0	0	500 AUD	95.87%	285'471.58	0.03	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	2'000	0	0	2'000 AUD	96.41%	1'148'365.94	0.11	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'550	0	0	1'550 AUD	80.62%	744'243.85	0.07	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	7'250	0	0	7'250 AUD	71.30%	3'078'424.28	0.28	a)
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US05253JAL52	3.7000 % ANZ 3.7 11/16/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	97.46%	893'881.90	0.08	a)
US05253JAX90	5.3750 % ANZ 5 3/8 07/03/25	1'900	0	0	1'900 USD	99.84%	1'739'831.72	0.16	a)
US05253JAY73	5.6710 % ANZ 5.671 10/03/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214FH19	5.3500 % WSTP 5.35 10/18/24	0	6'000	0	6'000 USD	99.78%	5'490'848.65	0.50	a)
AU							22'264'350.56	2.05	
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	0	7'750	0	7'750 EUR	98.55%	7'490'201.37	0.69	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	0	8'000	0	8'000 EUR	62.28%	4'885'922.64	0.45	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	5'500	0	1'500	4'000 EUR	95.95%	3'763'685.57	0.35	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	2'400	1'400	1'000 EUR	97.70%	958'102.69	0.09	a)
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	11'000	0	11'000 USD	95.65%	9'650'096.38	0.89	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	2'900	0	2'900 EUR	98.45%	2'799'827.33	0.26	a)
BE							29'547'835.98	2.72	
CA07813ZBZ68	3.3500 % BCECN 3.35 03/12/25 MTN	1'000	0	0	1'000 CAD	98.42%	657'055.51	0.06	a)
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	5'000	0	0	5'000 CAD	70.25%	2'344'929.28	0.22	a)
CA110709GC03	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/44	1'000	0	0	1'000 CAD	80.05%	534'395.00	0.05	a)
CA110709GJ55	2.9500 % BRCOL 2.95 06/18/50	3'000	0	0	3'000 CAD	73.76%	1'477'233.35	0.14	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	750	0	0	750 CAD	84.58%	423'482.17	0.04	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	0	1'800	0	1'800 CAD	97.52%	1'171'789.05	0.11	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	3'300	0	0	3'300 CAD	80.98%	1'783'925.35	0.16	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	7'500	0	7'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	0	7'500	0	7'500 CAD	98.39%	4'925'963.69	0.45	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	1'000	0	0	1'000 CAD	65.37%	436'381.42	0.04	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	3'000	0	0	3'000 CAD	92.62%	1'854'948.15	0.17	a)
CA136375CX83	3.0500 % CNRCN 3.05 02/08/50	1'500	0	0	1'500 CAD	70.84%	709'346.78	0.07	a)
CA44810ZBZ23	3.0200 % HYDONE 3.02 04/05/29 MTN	1'250	0	0	1'250 CAD	93.36%	779'061.80	0.07	a)
CA68333ZAN74	1.3500 % ONT 1.35 12/02/30	3'000	0	0	3'000 CAD	83.20%	1'666'250.97	0.15	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	6'300	0	0	6'300 CAD	86.95%	3'656'715.81	0.34	a)
CA69363TAN24	2.0500 % PSPCAP 2.05 01/15/30 12	3'000	0	0	3'000 CAD	88.70%	1'776'461.17	0.16	a)
CA74814ZFM01	2.1000 % Q 2.1 05/27/31	3'500	0	0	3'500 CAD	86.67%	2'025'083.36	0.19	a)
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	6'000	0	0	6'000 CAD	97.12%	3'890'262.12	0.36	a)
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	6'900	0	6'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US013051EH65	1.8750 % ALTA 1 7/8 11/13/24	0	8'000	0	8'000 USD	98.10%	7'197'719.83	0.66	a)
US06368D3S13	3.7000 % BMO 3.7 06/07/25 MTN	3'000	0	0	3'000 USD	97.96%	2'695'237.88	0.25	a)
US110709AD48	1.7500 % BRCOL 1 3/4 09/27/24 10	4'000	1'000	0	5'000 USD	98.48%	4'515'909.03	0.42	a)
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	2'000	0	0	2'000 USD	91.11%	1'671'212.39	0.15	a)
US11070TAM09	4.2000 % BRCOL 4.2 07/06/33	10'000	0	0	10'000 USD	93.74%	8'597'272.39	0.79	a)
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	2'000	0	0	2'000 USD	83.72%	1'535'584.25	0.14	a)
US22411WAZ95	4.2500 % CPPIBC 4 1/4 07/20/28 REGS	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	98.23%	1'261'257.34	0.12	a)
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	3'900	0	0	3'900 USD	86.06%	3'078'231.46	0.28	a)
US683234AR91	1.1250 % ONT 1 1/8 10/07/30	5'161	0	0	5'161 USD	78.91%	3'735'134.74	0.34	a)
US68323AFC36	3.0500 % ONT 3.05 01/29/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68323AFH23	1.6000 % ONT 1.6 02/25/31	5'000	0	0	5'000 USD	80.60%	3'696'297.93	0.34	a)
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	5'000	3'000	0	8'000 USD	98.17%	7'203'075.98	0.66	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	6'000	0	0	6'000 USD	86.56%	4'763'310.24	0.44	a)
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748148SC86	0.6000 % Q 0.6 07/23/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	0	3'500	0	3'500 USD	98.79%	3'171'247.90	0.29	a)
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	7'000	1'000	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	2'000	0	2'000 USD	98.20%	1'801'319.29	0.17	a)
US78016HZW32	5.1500 % RY 5.15 02/01/34 GMTN	0	1'785	0	1'785 USD	96.59%	1'581'336.32	0.15	a)
US89114QCB23	3.2500 % TD 3 1/4 03/11/24 GMTN	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZE53	0.7000 % TD 0.7 09/10/24 MTN	3'000	0	0	3'000 USD	98.25%	2'703'327.14	0.25	a)
USC23264AK75	0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 REGS	0	10'000	6'000	4'000 USD	95.14%	3'490'122.61	0.32	a)
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	91.77%	2'525'088.21	0.23	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	5'800	0	5'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	3'700	3'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC8888MBN77	4.7010 % TD 4.701 06/05/26 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	1'850	0	0	1'850 AUD	87.75%	966'781.14	0.09	a)
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	550	0	550	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2411135150	0.9500 % ONTFT 0.95 11/24/51 EMTN	500	0	0	500 EUR	53.68%	263'225.96	0.02	a)
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2645243853	6.0000 % CPPIBC 6 06/07/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	100.71%	1'156'574.56	0.11	a)
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	8'000	0	2'000	6'000 EUR	102.40%	6'025'164.49	0.55	a)
CA							103'747'716.06	9.54	
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	0	1'250	0	1'250 CHF	99.36%	1'242'000.00	0.11	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	1'500	0	1'500 CHF	99.21%	1'488'150.00	0.14	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	1'000	750	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	1'500	0	1'500 CHF	99.37%	1'490'550.00	0.14	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	1'000	1'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	1'000	750	0	1'750 CHF	90.65%	1'586'375.00	0.15	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	2'000	0	1'000	1'000 CHF	96.23%	962'300.00	0.09	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'000	0	0	2'000 CHF	83.90%	1'678'000.00	0.15	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	3'200	0	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	2'925	0	2'925 EUR	99.98%	2'867'908.48	0.26	a)
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	10'000	0	0	10'000 USD	99.19%	9'097'027.42	0.84	a)
US22550UAF84	6.6186 % UBS FLOAT 02/21/25 FRN	0	4'000	0	4'000 USD	100.39%	3'683'054.28	0.34	a)
USH42097CU99	3.1790 % UBS 3.179 02/11/43 REGS	4'000	0	1'600	2'400 USD	69.32%	1'525'734.05	0.14	a)
CH							25'621'099.23	2.36	
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	3'000	0	0	3'000 USD	70.05%	1'927'253.15	0.18	a)
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	0	1'225	0	1'225 USD	97.34%	1'093'567.24	0.10	a)
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	0	1'650	0	1'650 USD	100.16%	1'515'749.04	0.14	a)
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	98.94%	1'153'278.28	0.11	a)
CL							5'689'847.71	0.52	
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	100.15%	2'532'909.43	0.23	a)
CN							2'532'909.43	0.23	
CZ0001005037	0.2500 % CZGB 0 1/4 02/10/27 100	30'000	0	10'000	20'000 CZK	89.72%	698'964.66	0.06	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	0	40'000	10'000	30'000 CZK	82.31%	961'901.24	0.09	a)
CZ							1'660'865.90	0.15	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	0	22'900	10'900	12'000 EUR	97.72%	11'499'703.59	1.06	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	0	14'000	14'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	0	11'000	0	11'000 EUR	47.61%	5'135'855.65	0.47	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	0	3'500	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	9'000	4'000	5'000 EUR	99.28%	4'867'937.19	0.45	a)
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MK0	0.0000 % NRW 0 01/15/29	2'500	0	0	2'500 EUR	86.78%	2'127'485.37	0.20	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30254WAP41	2.7500 % FMSWVR 2 3/4 01/30/24	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	1'225'000	0	0	1'225'000 JPY	103.16%	7'365'116.71	0.68	a)
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	500'000	0	0	500'000 JPY	120.37%	3'507'654.97	0.32	a)
US500769GK42	2.5000 % KFW 2 1/2 11/20/24	5'000	3'000	0	8'000 USD	98.40%	7'219'951.54	0.66	a)
US500769JR67	1.2500 % KFW 1 1/4 01/31/25	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1551675488	2.3750 % RENTEN 2 3/8 01/23/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	6'000	600	0	6'600 EUR	80.55%	5'213'589.27	0.48	a)
XS2307309893	1.0000 % RENTEN 1 02/25/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 USD	86.45%	3'964'243.30	0.36	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	20'000	45'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	80.90%	3'966'654.39	0.36	a)
XS2433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
XS2451376219	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 03/03/34 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	83.16%	4'077'567.93	0.37	a)
XS2590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 CNY	100.31%	12'684'147.22	1.17	a)
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE							71'629'907.13	6.58	
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	6'750	0	0	6'750 DKK	89.59%	795'155.77	0.07	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	5'500	0	0	5'500 DKK	98.18%	709'981.13	0.07	a)
DK0009924375	0.0000 % DGB 0 11/15/31 G	7'000	0	0	7'000 DKK	83.03%	764'209.92	0.07	a)
XS2615916850	3.3750 % KOMMUN 3 3/8 04/26/43 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	100.08%	1'177'684.03	0.11	a)
DK							3'447'030.85	0.32	
XS2181347183	0.1250 % ESTONI 0 1/8 06/10/30	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EE							0.00	0.00	
AU3CB0297596	5.6780 % SANTAN 5.678 03/09/28 FXD	2'850	0	0	2'850 AUD	99.78%	1'693'502.37	0.16	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	2'000	2'000	0	4'000 EUR	53.79%	2'109'965.74	0.19	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	12'000	0	2'000	10'000 EUR	71.64%	7'025'210.35	0.65	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	12'000	4'000	6'000	10'000 EUR	82.71%	8'111'201.94	0.75	a)
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 EUR	100.21%	4'913'783.41	0.45	a)
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	100'000	0	0	100'000 JPY	99.74%	581'313.33	0.05	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	4'000	0	4'000 USD	98.92%	3'628'832.38	0.33	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	0	5'000	0	5'000 USD	90.55%	4'152'304.91	0.38	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	5'000	1'000	0	6'000 USD	99.96%	5'500'753.87	0.51	a)
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	2'500	1'500	0	4'000 GBP	87.11%	4'001'333.86	0.37	a)
XS2634826031	4.2500 % SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN	4'100	0	0	4'100 EUR	102.94%	4'138'907.72	0.38	a)
ES							45'857'109.88	4.22	
XS1964628991	2.5000 % KUNTA 2 1/2 11/15/23 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
FI							0.00	0.00	
AU3CB0252625	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 04/26/28 MTN	500	0	0	500 AUD	93.80%	279'298.69	0.03	a)
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	94.73%	1'104'158.46	0.10	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 19Y	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003CJ5	0.8750 % SOGRPR 0 7/8 05/10/46 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	58.06%	569'414.99	0.05	a)
FR00140095D5	0.5000 % CFF 0 1/2 03/16/28 EMTN	4'000	1'000	0	5'000 EUR	89.96%	4'410'995.00	0.41	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 16Y	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54 31Y	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I3C5	3.4700 % BNFP 3.47 05/22/31 EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I4X9	4.1250 % BNP 4 1/8 05/24/33 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	3'000	0	0	3'000 EUR	100.94%	2'969'511.31	0.27	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	5'900	0	5'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	6'200	0	6'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	0	2'800	0	2'800 EUR	99.76%	2'739'170.09	0.25	a)
FR001400NCB6	5.7500 % SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN	0	1'600	0	1'600 GBP	98.49%	1'809'617.55	0.17	a)
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400P8C5	4.0000 % TISSEO 4 04/08/39 EMTN	0	5'900	900	5'000 EUR	97.77%	4'793'945.80	0.44	a)
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	800'000	0	0	800'000 JPY	99.55%	4'641'647.84	0.43	a)
JP525021APC0	0.8950 % BPCEGP 0.895 12/14/26 36	0	600'000	0	600'000 JPY	99.71%	3'486'900.86	0.32	a)
JP525022AQ16	0.7240 % ACAFP 0.724 01/26/27 22	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.71%	5'811'035.18	0.53	a)
JP525022CP64	1.2330 % ACAFP 1.233 06/13/33 21	0	200'000	0	200'000 JPY	97.06%	1'131'341.05	0.10	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	3'785	0	3'785	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06675GAZ81	4.9350 % BFCM 4.935 01/26/26 REGS	0	2'739	0	2'739 USD	98.80%	2'481'979.21	0.23	a)
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	80.49%	3'691'161.89	0.34	a)
US83368TBD90XXX	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	97.11%	2'671'905.58	0.25	a)
XS1046806821	3.3750 % CADES 3 3/8 03/20/24 REGS	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2345996230	0.3750 % CADES 0 3/8 05/27/24 REGS	5'000	2'000	0	7'000 USD	99.65%	6'397'323.02	0.59	a)
FR							48'989'406.52	4.50	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	200	0	0	200 AUD	98.90%	117'800.06	0.01	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	250	0	0	250 AUD	99.60%	148'287.82	0.01	a)
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	2'750	0	0	2'750 GBP	44.00%	1'389'701.66	0.13	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	1'300	200	0	1'500 GBP	78.54%	1'352'958.30	0.12	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	6'500	1'000	0	7'500 GBP	62.91%	5'418'224.12	0.50	a)
GB00BM82Z521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	7'100	3'500	500	10'100 GBP	73.97%	8'579'267.99	0.79	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'500	0	500	2'000 GBP	48.90%	1'123'144.36	0.10	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	5'000	5'000	0	10'000 GBP	38.48%	4'419'423.78	0.41	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	3'500	2'250	1'250 GBP	75.43%	1'082'820.84	0.10	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	3'000	300	0	3'300 GBP	66.69%	2'527'346.99	0.23	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	0	4'000	0	4'000 USD	81.88%	3'003'923.05	0.28	a)
US046353AX64	2.1250 % AZN 2 1/8 08/06/50	2'000	0	0	2'000 USD	55.00%	1'008'791.63	0.09	a)
US06738EAN58	4.3750 % BACR 4 3/8 01/12/26	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	1'800	0	0	1'800 USD	99.66%	1'645'207.52	0.15	a)
US06739FHV67	3.7500 % BACR 3 3/4 05/15/24 BKNT	4'000	0	0	4'000 USD	99.92%	3'665'775.18	0.34	a)
US539439AV19	2.4380 % LLOYDS 2.438 02/05/26	3'000	0	0	3'000 USD	97.26%	2'676'087.78	0.25	a)
US53944YAS28	3.7500 % LLOYDS 3 3/4 03/18/28	6'000	0	0	6'000 USD	94.66%	5'209'155.20	0.48	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AL28	5.5830 % NWG 5.583 03/01/28	0	1'675	0	1'675 USD	99.40%	1'526'962.81	0.14	a)
USG6382GVA77	0.8000 % NWG 0.8 08/12/24 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	98.60%	1'808'638.14	0.17	a)
USG6398ADD66	5.2640 % NWIDE 5.264 11/10/26 REGS	0	7'500	1'000	6'500 USD	99.81%	5'949'850.12	0.55	a)
XS2025842688	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN	2'000	0	1'500	500 GBP	99.30%	570'202.48	0.05	a)
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	0	200'000	0	200'000 JPY	97.25%	1'133'579.07	0.10	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	91.62%	1'260'453.00	0.12	a)
XS2445344570	2.6250 % SVTLN 2 5/8 02/22/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2462446696	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/29/38 EMTN	550	0	550	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2574870759	3.5000 % MOTOPG 3 1/2 07/17/31 EMTN	6'000	0	2'000	4'000 EUR	98.74%	3'873'245.78	0.36	a)
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	2'500	2'500	0	5'000 EUR	102.28%	5'014'890.27	0.46	a)
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	2'000	3'000	0	5'000 EUR	102.59%	5'030'286.75	0.46	a)
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	4'800	0	300	4'500 EUR	101.57%	4'482'333.68	0.41	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	1'800	0	1'800 GBP	102.50%	2'118'897.97	0.19	a)
XS2741906809	5.3500 % NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN	0	1'550	0	1'550 GBP	95.94%	1'707'711.72	0.16	a)
XS2742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	3'900	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	100.74%	1'156'907.60	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	6'000	2'000	4'000 EUR	99.37%	3'898'115.52	0.36	a)
GB							82'899'991.19	7.62	
JP534411AK62	0.2040 % HSBC 0.204 06/25/24 3	100'000	0	0	100'000 JPY	99.93%	582'414.86	0.05	a)
HK							582'414.86	0.05	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	3'000	0	0	3'000 USD	80.36%	2'210'927.65	0.20	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	3'400	0	0	3'400 EUR	102.32%	3'411'592.46	0.31	a)
IE							5'622'520.11	0.52	
XS2293755125	0.0000 % ICELND 0 04/15/28	0	4'000	0	4'000 EUR	87.33%	3'425'786.65	0.31	a)
XS2779814750	5.0000 % LANBNN 5 05/13/28 EMTN	0	1'650	1'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2788435050	3.5000 % ICELND 3 1/2 03/21/34	0	3'450	3'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2792180197	4.6250 % ISLBN 4 5/8 03/27/28	0	3'400	0	3'400 EUR	99.26%	3'309'730.49	0.30	a)
IS							6'735'517.14	0.62	
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	0	10'000	0	10'000 EUR	76.41%	7'493'283.12	0.69	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	3'500	0	0	3'500 EUR	69.61%	2'389'284.46	0.22	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005570988	4.6000 % UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN	0	6'250	6'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2311539691	0.6800 % ISPIM 0.68 03/11/24 EMTN	1'300'000	0	1'300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS2433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.85%	5'819'486.03	0.53	a)
XS2630420268	6.6250 % ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN	2'000	0	2'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2783772614	1.2730 % ISPIM 1.273 03/13/26 EMTN	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.66%	5'808'412.50	0.53	a)
IT							21'510'466.11	1.98	
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.60%	1'160'913.18	0.11	a)
JP316572BMA4	0.1000 % NTT 0.1 09/18/26 21	200'000	0	0	200'000 JPY	98.95%	1'153'371.53	0.11	a)
US62954WAC91	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 144A	8'000	2'000	0	10'000 USD	92.13%	8'449'427.81	0.78	a)
XS0241265445	4.5000 % EJRAIL 4 1/2 01/25/36	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	103.95%	2'140'831.28	0.20	a)
JP							12'904'543.80	1.19	
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	5'000'000	0	0	5'000'000 KRW	96.91%	3'215'395.14	0.30	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	5'000'000	0	0	5'000'000 KRW	78.86%	2'616'406.62	0.24	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	1'000'000	0	0	1'000'000 KRW	75.08%	498'215.58	0.05	a)
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	68.51%	1'363'799.28	0.13	a)
KR103502GAC2	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/30 3012	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	87.53%	1'742'601.26	0.16	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	5'000'000	1'000'000	0	6'000'000 KRW	96.77%	3'852'939.09	0.35	a)
US500630CW64	3.2500 % KDB 3 1/4 02/19/24	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DF23	0.4000 % KDB 0.4 06/19/24	7'000	0	0	7'000 USD	99.30%	6'375'302.25	0.59	a)
US500630DT27	4.0000 % KDB 4 09/08/25	2'345	0	0	2'345 USD	97.93%	2'106'261.43	0.19	a)
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	4'300	0	0	4'300 USD	100.13%	3'948'674.68	0.36	a)
XS2623871196	3.3750 % KDB 3 3/8 05/23/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	99.36%	2'923'086.50	0.27	a)
XS2740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	0	3'500	0	3'500 EUR	99.11%	3'401'789.71	0.31	a)
XS2775400703	5.5000 % SHINCA 5 1/2 03/12/29	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
KR							32'044'471.54	2.95	
XS2487342649	2.1250 % LITHUN 2 1/8 06/01/32 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	90.13%	1'767'673.43	0.16	a)
LT							1'767'673.43	0.16	
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	3'600	0	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A2SCAM1	2.6250 % EFSF 2 5/8 07/16/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	98.19%	1'925'776.70	0.18	a)
XS2020670852	1.0000 % MDT 1 07/02/31	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2447550893	3.0000 % PRIFII 3 02/22/42 EMTN	450	0	450	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
LU							1'925'776.70	0.18	
XS2317123052	0.0000 % LATVIA 0 03/17/31 GMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	78.86%	1'546'748.58	0.14	a)
LV							1'546'748.58	0.14	
US02364WBE49	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 07/16/42	3'000	0	0	3'000 USD	82.85%	2'279'521.30	0.21	a)
US02364WBJ36	2.8750 % AMXLMM 2 7/8 05/07/30	6'000	0	0	6'000 USD	86.13%	4'739'482.68	0.44	a)
MX							7'019'003.98	0.65	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AU3CB0241974	3.5000 % NEDWBK 3 1/2 07/20/27 MTN	2'500	0	0	2'500 AUD	96.44%	1'435'889.19	0.13	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	2'000	0	0	2'000 AUD	93.18%	1'109'857.58	0.10	a)
US21688AAQ58	0.3750 % RABOBK 0 3/8 01/12/24	0	3'477	3'477	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US82620KAZ66	1.2000 % SIEGR 1.2 03/11/26 144A	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	5'000	0	0	5'000 EUR	79.63%	3'904'725.22	0.36	a)
XS2182093943	1.0000 % BNG 1 06/03/30 REGS	5'440	0	0	5'440 USD	79.25%	3'954'216.65	0.36	a)
XS2204965540	0.2500 % NEDWBK 0 1/4 12/15/25 EMTN	2'250	0	0	2'250 GBP	92.51%	2'390'307.88	0.22	a)
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	7'250	0	0	7'250 EUR	76.81%	5'461'354.02	0.50	a)
XS2381566616	0.0000 % BNG 0 08/31/28 EMTN	7'500	1'200	4'700	4'000 EUR	87.64%	3'437'633.12	0.32	a)
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2436690734	1.1250 % NEDWBK 1 1/8 03/15/24 REGS	8'000	0	8'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2485170695	2.8750 % NEDWBK 2 7/8 05/24/24 EMTN	8'000	0	4'000	4'000 USD	99.83%	3'662'510.12	0.34	a)
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	1'350	0	1'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRNED 3 5/8 12/12/28	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	4'700	2'000	2'700 EUR	104.13%	2'757'263.41	0.25	a)
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	0	7'000	0	7'000 EUR	95.73%	6'571'416.10	0.60	a)
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	3'800	0	3'800 EUR	98.69%	3'677'571.16	0.34	a)
NL							38'362'744.45	3.53	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	200	800	0	1'000 NOK	95.68%	79'240.39	0.01	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	1'300	1'700	0	3'000 NOK	93.29%	231'795.47	0.02	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	0	5'000	0	5'000 NOK	83.60%	346'199.98	0.03	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	2'300	0	0	2'300 NOK	98.37%	187'375.01	0.02	a)
US25601C2B81	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2014307800	2.0000 % KBN 2 06/19/24 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	99.54%	1'095'517.33	0.10	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	14'000	3'000	0	17'000 USD	79.74%	12'432'857.89	1.14	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	91.51%	3'589'715.09	0.33	a)
XS2462667861	2.5000 % KBN 2 1/2 09/27/24 REGS	0	7'500	0	7'500 USD	98.78%	6'794'361.84	0.62	a)
XS2537112059	3.7500 % KBN 3 3/4 09/26/25 EMTN	3'000	0	1'500	1'500 GBP	98.01%	1'688'385.71	0.16	a)
XS2779793061	3.7500 % STATK 3 3/4 03/22/39 EMTN	0	1'300	0	1'300 EUR	100.24%	1'277'915.15	0.12	a)
NO							27'723'363.86	2.55	
AU3CB0239754	2.9000 % AUCCCN 2.9 09/16/27	500	0	0	500 AUD	92.66%	275'912.98	0.03	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	5'250	0	0	5'250 NZD	99.82%	2'844'198.18	0.26	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	3'500	0	0	3'500 NZD	83.69%	1'589'661.58	0.15	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZSZ 5.355 08/14/28 REGS	3'100	0	0	3'100 USD	99.61%	2'831'991.36	0.26	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	90.88%	2'500'380.19	0.23	a)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	79.56%	2'918'554.73	0.27	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	99.28%	3'642'222.77	0.33	a)
US96122QAB95	5.1320 % WSTPNZ 5.132 02/26/27 REGS	0	10'000	0	10'000 USD	98.93%	9'073'548.38	0.83	a)
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	80.17%	3'144'688.01	0.29	a)
XS2381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	3'000	3'000	2'000	4'000 EUR	86.28%	3'384'363.24	0.31	a)
NZ							32'205'521.42	2.96	
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	14'500	0	14'500	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	8'000	0	0	8'000 SEK	99.18%	663'001.24	0.06	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	6'000	0	0	6'000 SEK	95.50%	478'810.83	0.04	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	6'000	5'000	0	11'000 SEK	92.88%	853'719.38	0.08	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	2'000	0	7'000 SEK	84.97%	496'985.21	0.05	a)
SE0015193313	0.5000 % SGB 0 1/2 11/24/45 #1063 1063	1'000	0	0	1'000 SEK	65.35%	54'604.18	0.01	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	10'000	0	10'000 SEK	93.89%	784'531.41	0.07	a)
USW8454EAT56	5.1250 % SEB 5 1/8 03/05/27 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	99.58%	1'741'177.44	0.16	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	1'500	0	0	1'500 SEK	86.31%	108'186.42	0.01	a)
XS2474788929	2.7500 % KOMINS 2 3/4 03/01/25 REGS	5'000	3'000	3'000	5'000 USD	97.76%	4'483'029.20	0.41	a)
XS2490493959	2.8750 % KOMINS 2 7/8 07/03/24 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	99.54%	1'825'825.53	0.17	a)
XS2496002614	3.2500 % KOMINS 3 1/4 01/16/24 REGS	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SE							11'489'870.84	1.06	
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	0	3'000	3'000	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	8'500	3'500	5'000 USD	94.69%	4'342'063.25	0.40	a)
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	1'800	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2310058891	1.8220 % DB5SP 1.822 03/10/31 GMTN	2'200	0	0	2'200 USD	92.94%	1'875'177.38	0.17	a)
SG							6'217'240.63	0.57	
XS0982709221	5.2500 % SLOVEN 5 1/4 02/18/24 REGS	0	1'849	1'849	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2635185437	5.0000 % SLOVEN 5 09/19/33 REGS	3'400	6'600	0	10'000 USD	97.27%	8'921'301.48	0.82	a)
SI							8'921'301.48	0.82	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOSPO 5 3/8 10/04/28 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK							0.00	0.00	
US001055AQ51	2.8750 % AFL 2 7/8 10/15/26	8'000	0	6'000	2'000 USD	94.09%	1'725'819.50	0.16	a)
US001055AY85	4.7500 % AFL 4 3/4 01/15/49	4'000	0	0	4'000 USD	86.51%	3'173'815.92	0.29	a)
US00206RCU41	5.6500 % T 5.65 02/15/47	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RKA94	3.6500 % T 3.65 06/01/51	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RML32	1.7000 % T 1.7 03/25/26	5'000	0	0	5'000 USD	93.17%	4'272'634.99	0.39	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	2'500	0	0	2'500 USD	90.22%	2'068'585.97	0.19	a)
US00287YBZ16	2.6000 % ABBV 2.6 11/21/24	3'000	0	0	3'000 USD	98.39%	2'707'151.66	0.25	a)
US00287YDW66	5.4000 % ABBV 5.4 03/15/54	0	4'900	4'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00846UAM36	2.1000 % A 2.1 06/04/30	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	2'875	0	2'875 USD	100.06%	2'638'361.97	0.24	a)
US03040WAV72	4.1500 % AWK 4.15 06/01/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03040WAY12	2.3000 % AWK 2.3 06/01/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	2'000	3'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AN31	2.2500 % ELV 2 1/4 05/15/30	0	2'000	0	2'000 USD	83.45%	1'530'631.64	0.14	a)
US036752AS28	3.6000 % ELV 3.6 03/15/51	2'000	0	0	2'000 USD	70.18%	1'287'385.11	0.12	a)
US037833CG39	3.0000 % AAPL 3 02/09/24	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04636NAC74	0.7000 % AZN 0.7 05/28/24	0	2'000	0	2'000 USD	99.64%	1'827'751.55	0.17	a)
US04636NAE31	1.7500 % AZN 1 3/4 05/28/28	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	95.96%	4'400'348.13	0.40	a)
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	3'000	2'500	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJE08	2.6760 % BAC 2.676 06/19/41 MTN	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJS93	1.7340 % BAC 1.734 07/22/27	0	6'000	0	6'000 USD	91.71%	5'046'929.71	0.46	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	5'000	0	0	5'000 USD	86.99%	3'989'189.78	0.37	a)
US06051GKK49	2.9720 % BAC 2.972 02/04/33 MTN	3'500	6'500	4'000	6'000 USD	82.44%	4'536'590.76	0.42	a)
US06051GKS74	3.8410 % BAC 3.841 04/25/25	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09247XAN12	3.2000 % BLK 3.2 03/15/27	5'000	0	0	5'000 USD	95.12%	4'361'827.83	0.40	a)
US09247XQA43	2.4000 % BLK 2.4 04/30/30	1'500	0	0	1'500 USD	85.78%	1'180'124.42	0.11	a)
US110122CQ99	4.1250 % BMY 4 1/8 06/15/39	5'000	0	0	5'000 USD	84.42%	3'871'198.44	0.36	a)
US126408HU08	4.1000 % CSX 4.1 11/15/32	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967MD09	4.6500 % C 4.65 07/23/48	3'000	0	0	3'000 USD	85.44%	2'350'921.42	0.22	a)
US17325FBA57	5.8640 % C 5.864 09/29/25	4'300	0	0	4'300 USD	100.59%	3'966'815.91	0.36	a)
US20030NCJ81	3.9000 % CMCSA 3.9 03/01/38	6'000	0	3'000	3'000 USD	82.87%	2'280'044.07	0.21	a)
US254687CZ75	3.7000 % DIS 3.7 09/15/24	0	6'000	0	6'000 USD	99.25%	5'461'793.34	0.50	a)
US36264FAL58	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/24/29	3'000	0	0	3'000 USD	91.21%	2'509'707.60	0.23	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	1'000	0	0	1'000 USD	99.93%	916'544.68	0.08	a)
US40428HA448	5.2940 % HSBC 5.294 03/04/27	0	4'175	0	4'175 USD	99.63%	3'814'818.70	0.35	a)
US40428HA513	0.0000 % HSBC FLOAT 03/04/27	0	4'175	4'175	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAC90	3.4000 % HPQ 3.4 06/17/30	0	4'000	0	4'000 USD	88.79%	3'257'496.68	0.30	a)
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	4'900	0	0	4'900 USD	100.01%	4'494'394.52	0.41	a)
US437076BC57	3.7500 % HD 3 3/4 02/15/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200JH57	4.7000 % IBM 4.7 02/19/46	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PBH82	2.0050 % JPM 2.005 03/13/26	0	5'000	0	5'000 USD	96.75%	4'436'758.98	0.41	a)
US46647PBT21	1.0450 % JPM 1.045 11/19/26	0	5'000	0	5'000 USD	93.06%	4'267'315.52	0.39	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	5'000	0	5'000 USD	83.19%	3'815'023.00	0.35	a)
US46647PCZ71	4.0800 % JPM 4.08 04/26/26	0	5'000	0	5'000 USD	98.27%	4'506'554.10	0.41	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	3'000	0	0	3'000 USD	84.68%	2'330'010.40	0.21	a)
US548661DV65	5.0000 % LOW 5 04/15/40	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EA10	2.6250 % LOW 2 5/8 04/01/31	0	6'000	0	6'000 USD	83.83%	4'612'915.98	0.42	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	4'000	2'500	3'500	3'000 USD	77.31%	2'127'090.97	0.20	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	4'650	0	4'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629W4564	5.1000 % MASSMU 5.1 04/09/27 144A	0	5'000	2'000	3'000 USD	99.44%	2'736'096.91	0.25	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	0	3'000	0	3'000 USD	75.11%	2'066'586.58	0.19	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YAX31	3.4000 % MRK 3.4 03/07/29	3'000	0	0	3'000 USD	92.78%	2'552'740.28	0.23	a)
US58989V2H68	5.2500 % MET 5 1/4 04/12/29 144A	0	4'000	0	4'000 USD	98.79%	3'624'136.57	0.33	a)
US59156RBD98	4.1250 % MET 4 1/8 08/13/42	1'000	0	0	1'000 USD	80.82%	741'268.14	0.07	a)
US59217GCT40	3.6000 % MET 3.6 01/11/24 144A	0	4'965	4'965	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GFP90	5.1500 % MET 5.15 03/28/33 144A	0	2'500	0	2'500 USD	96.84%	2'220'351.36	0.20	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	3'000	0	0	3'000 USD	65.80%	1'810'316.53	0.17	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	5'000	5'000	0	10'000 USD	92.62%	8'494'735.02	0.78	a)
US64952WFE84	5.0000 % NYLIFE 5 01/09/34 144A	0	5'000	0	5'000 USD	95.60%	4'384'068.72	0.40	a)
US66815L2R98	5.0700 % NWMLIC 5.07 03/25/27 144A	0	4'700	0	4'700 USD	99.27%	4'279'310.01	0.39	a)
US66989HAG39	3.4000 % NOVNVX 3.4 05/06/24	0	2'000	0	2'000 USD	100.00%	1'834'300.00	0.17	a)
US66989HAH12	4.4000 % NOVNVX 4.4 05/06/44	2'000	0	0	2'000 USD	86.88%	1'593'566.47	0.15	a)
US66989HAQ11	2.0000 % NOVNVX 2 02/14/27	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XBN03	2.1250 % PLD 2 1/8 04/15/27	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109AZ71	0.7500 % O 0 3/4 03/15/26	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109BL76	2.8500 % O 2.85 12/15/32	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	6'000	0	6'000 USD	97.97%	5'391'301.19	0.50	a)
US87264ACA16	2.0500 % TMUS 2.05 02/15/28	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACT07	3.4000 % TMUS 3.4 10/15/52	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	0	3'050	0	3'050 USD	96.27%	2'692'828.06	0.25	a)
US883556CL42	2.0000 % TMO 2 10/15/31	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FW39	2.9500 % UNP 2.95 03/10/52	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FX12	2.8000 % UNP 2.8 02/14/32	5'000	3'000	4'000	4'000 USD	84.37%	3'095'344.56	0.28	a)
US92343VGC28	3.7000 % VZ 3.7 03/22/61	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAE21	4.1500 % V 4.15 12/14/35	2'000	0	0	2'000 USD	90.90%	1'667'305.33	0.15	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	4'000	3'000	2'000	5'000 USD	84.58%	3'878'443.92	0.36	a)
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU74078CD32	4.0000 % NESNVX 4 09/24/48 REGS	1'000	3'000	0	4'000 USD	79.24%	2'906'888.58	0.27	a)
USU74078CK74	1.1500 % NESNVX 1.15 01/14/27 REGS	0	4'000	0	4'000 USD	89.63%	3'288'202.87	0.30	a)
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	0	2'700	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BV72	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 REGS	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BW55	1.9300 % ROSW 1.93 12/13/28 REGS	5'000	0	0	5'000 USD	86.66%	3'974'010.95	0.37	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	2'000	4'000	0	6'000 USD	59.17%	3'255'790.79	0.30	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	1'700	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	300'000	0	0	300'000 JPY	98.62%	1'724'252.44	0.16	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	200'000	0	0	200'000 JPY	99.86%	1'164'025.43	0.11	a)
XS1879223565	2.9000 % T 2.9 12/04/26 GBP	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1892836104	1.1590 % AFL 1.159 10/18/30	0	500'000	0	500'000 JPY	98.33%	2'865'303.22	0.26	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	0	0	1'000 GBP	85.32%	979'776.94	0.09	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	2'400	0	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2583742668	4.0000 % IBM 4 02/06/43	2'500	0	0	2'500 EUR	100.69%	2'468'659.72	0.23	a)
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	2'300	0	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	3'000	0	0	3'000 EUR	99.91%	2'939'296.94	0.27	a)
US							182'395'460.78	16.77	
AU3CB0243194	4.5000 % CAF 4 1/2 09/14/27 MTN	620	0	0	620 AUD	96.45%	356'122.67	0.03	a)
CA298713AK48	4.5500 % EUROF 4.55 03/30/27 MPLE	500	0	0	500 CAD	100.01%	333'828.31	0.03	a)
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	14'000	3'000	2'000	15'000 EUR	85.72%	12'608'691.84	1.16	a)
EU000A3K4EA2	0.0000 % EUB 0 01/12/24 6M	7'400	1'000	8'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EV8	0.0000 % EUB 0 10/04/24 6M	0	5'500	0	5'500 EUR	98.43%	5'309'154.37	0.49	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	6'500	8'400	1'400	13'500 EUR	62.98%	8'337'667.57	0.77	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP500113AL71	0.7700 % CAF 0.77 07/30/25 14	0	200'000	0	200'000 JPY	100.04%	1'166'100.25	0.11	a)
JP500113AM39	0.2500 % CAF 0 1/4 03/19/24 18	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US045167FG35	0.6250 % ASIA 0 5/8 10/08/24 GMTN	4'000	4'500	0	8'500 USD	97.94%	7'635'337.95	0.70	a)
US045167FS72	4.1250 % ASIA 4 1/8 09/27/24 GMTN	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167GB39	4.1250 % ASIA 4 1/8 01/12/34 GMTN	0	9'000	0	9'000 USD	94.59%	7'808'037.30	0.72	a)
US15238RAJ14	5.0000 % CABEI 5 01/25/27 REGS	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	1'800	0	0	1'800 USD	97.81%	1'614'699.44	0.15	a)
US219868CF16	2.2500 % CAF 2 1/4 02/08/27	5'000	0	0	5'000 USD	91.27%	4'185'597.46	0.38	a)
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	6'000	0	500	5'500 USD	98.15%	4'951'055.43	0.46	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	5'050	5'000	5'000	5'050 USD	101.25%	4'689'363.65	0.43	a)
US222213AS92	2.5000 % COE 2 1/2 02/27/24	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JM97	0.3750 % EIB 0 3/8 07/24/24	0	5'000	0	5'000 USD	98.84%	4'532'601.16	0.42	a)
US4581X0BX51	3.2000 % IADB 3.2 08/07/42	2'283	5'000	0	7'283 USD	76.68%	5'121'853.13	0.47	a)
US4581X0CM87	2.1250 % IADB 2 1/8 01/15/25	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DP00	0.2500 % IADB 0 1/4 11/15/23	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	4'000	0	0	4'000 USD	90.38%	3'315'643.99	0.30	a)
US459056HV23	1.5000 % IBRD 1 1/2 08/28/24 GDIF	6'000	0	0	6'000 USD	98.74%	5'433'783.58	0.50	a)
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	5'000	0	0	5'000 USD	80.08%	3'672'131.03	0.34	a)
US65562QBL86	2.2500 % NIB 2 1/4 05/21/24	2'000	0	0	2'000 USD	99.83%	1'831'181.69	0.17	a)
XS0241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	300'000	200'000	0	500'000 JPY	102.93%	2'999'438.55	0.28	a)
XS0282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	0	700'000	0	700'000 JPY	105.04%	4'285'255.24	0.39	a)
XS0307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	0	300'000	0	300'000 JPY	106.32%	1'859'023.04	0.17	a)
XS1588672144	6.5000 % EIB 6 1/2 07/07/27 EMTN	0	20'000	0	20'000 MXN	89.83%	967'064.88	0.09	a)
XS1622379698	3.0000 % EIB 3 05/24/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 PLN	99.85%	678'992.02	0.06	a)
XS1649504096	7.0000 % IFC 7 07/20/27 GMTN	0	50'000	0	50'000 MXN	90.78%	2'443'311.29	0.22	a)
XS1753775730	7.7500 % IFC 7 3/4 01/18/30 GMTN	0	100'000	0	100'000 MXN	90.33%	4'862'238.44	0.45	a)
XS1958237403	2.9000 % ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	100'000	0	100'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS1963719585	3.0000 % EIB 3 11/25/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 PLN	87.01%	591'681.10	0.05	a)
XS1998795535	2.8750 % EIB 2 7/8 11/15/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 PLN	86.05%	585'159.98	0.05	a)
XS2191236715	4.2500 % EIB 4 1/4 06/19/24 EMTN	7'500	0	0	7'500 MXN	99.04%	399'814.94	0.04	a)
XS2288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	40'000	0	0	40'000 CNY	99.28%	5'021'510.08	0.46	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	9'000	0	9'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2337107259	0.8750 % IDAWBG 0 7/8 04/28/26 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	92.02%	2'531'774.23	0.23	a)
XS2388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	100'000	26'500	0	126'500 CNY	99.04%	15'843'094.58	1.46	a)
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	25'000	0	0	25'000 CNY	98.47%	3'112'868.88	0.29	a)
XS2473766314	3.2500 % IBRD 3 1/4 04/28/25 EMTN	50'000	0	0	50'000 CNY	100.19%	6'334'739.39	0.58	a)
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	6'000	0	2'000	4'000 EUR	95.56%	3'748'426.37	0.34	a)
XS2539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	99.43%	3'771'784.97	0.35	a)
XS2574358227	2.7000 % ASIA 2.7 01/17/26 EMTN	0	74'000	0	74'000 CNY	99.54%	9'314'403.74	0.86	a)
XS257528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	99.62%	1'259'752.76	0.12	a)
XS2707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	75'000	45'000	0	120'000 CNY	97.14%	14'740'711.96	1.36	a)

XS **168'253'897.26** **15.47**

Derivative Finanzinstrumente **-10'800'269.33** **-0.99**

Futures							0.00	0.00
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	-30	30	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	-75	75	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	-100	100	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	0	100	100	0 GBP	0.00	0.00	0.00
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	250	250	0 EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	30	30	0 EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	155	155	0 GBP	0.00	0.00	0.00
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	75	125	-50 EUR	0.00	0.00	0.00 a)
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	125	25	100 EUR	0.00	0.00	0.00 a)
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	0	30	-30 EUR	0.00	0.00	0.00 a)
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	55	0	55 GBP	0.00	0.00	0.00 a)

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

NZD/CHF Verfall 16.11.2023	92'981	175'000	CHF/NZD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 16.11.2023	74'610	925'000	CHF/SEK	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AUD/CHF	Verfall 16.11.2023		390'830	675'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 16.11.2023		18'727	225'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2023		10'607'765	11'925'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023		854'864	775'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 16.11.2023		43'903	1'775'000	CHF/THB		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023		647'206	975'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 16.11.2023		89'181	1'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2023		120'866'248	135'875'000	CHF/USD		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 16.11.2023		505'229	20'425'000	CHF/THB		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023		9'706'840	8'800'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023		30'228'299	4'975'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023		5'065'459	5'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 16.11.2023		857'002	10'625'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 16.11.2023		222'667	2'675'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 16.11.2023		372'090	2'900'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023		41'154	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 16.11.2023		1'027'571	19'875'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 16.11.2023		4'473'069	7'725'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 16.11.2023		622'042	15'950'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 16.11.2023		483'560	2'350'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023		2'016'762	16'500'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 16.11.2023		53'622	1'375'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 16.11.2023		1'129'121	2'125'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 16.11.2023		311'145	475'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 16.11.2023		286'781	1'225'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023		2'643'077	435'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023		58'133'311	60'825'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023		23'223'320	190'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023		7'484'356	11'275'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		25'000	23'900	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 16.11.2023		2'200'000	269'355	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		70'000'000	425'575	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		850'000	812'603	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 16.11.2023		175'000	116'242	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		2'175'000	1'935'693	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		200'000	177'995	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		5'500'000	33'438	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 16.11.2023		75'000	43'950	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		2'525'000	2'302'303	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		12'000'000	73'792	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 16.11.2023		100'000	5'135	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		650'000	627'485	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 16.11.2023		125'000	4'940	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 16.11.2023		125'000	3'116	THB/CHF		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023		196'894	1'575'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 16.11.2023		50'000	4'170	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 16.11.2023		125'000	84'541	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.11.2023		125'000	138'403	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		500'000	480'151	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		1'000'000	911'433	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 16.11.2023		125'000	72'376	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		45'000'000	277'457	JPY/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023		242'443	40'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 16.11.2023		60'611	10'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023		82'699	125'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 16.11.2023		16'540	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023		811'615	850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 16.11.2023		95'484	100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2023		135'501	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2023		1'151'757	1'275'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 16.11.2023		71'154	575'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 16.11.2023		110'378	100'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		175'000	156'768	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 16.11.2023		75'000	49'123	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		575'000	543'323	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 16.11.2023		2'000'000	244'838	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 16.11.2023		25'000	23'623	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		40'000'000	240'200	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 16.11.2023		125'000	136'087	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 16.11.2023		150'000	18'363	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 16.11.2023		1'825'000	1'635'120	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 16.11.2023		6'000'000	36'039	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 16.11.2023		10'000	6'542	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 16.11.2023		20'000	11'499	AUD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		2'030	25'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		5'388	25'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		14'220	175'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 16.11.2023		215'439	325'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		3'631'064	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		37'136	300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		48'010	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		15'053	300'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		27'528	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		333'131	13'225'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		1'254	25'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		28'968	1'150'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		1'195'683	9'650'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		193'151	1'500'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		114'563	175'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		12'692	325'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		2'738'893	2'850'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		827'024	750'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 16.11.2023		25'000	14'392	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		660'303	110'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 16.11.2023		165'272	150'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 16.11.2023		937'343	975'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 16.11.2023		131'297	200'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 16.11.2023		301'177	50'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 16.11.2023		5'684	25'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2023		2'534'283	2'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 16.11.2023		4'904	125'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 16.11.2023		234'827	1'900'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 16.11.2023		14'533	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 16.11.2023		6'440	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 16.11.2023		8'988	175'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 16.11.2023		8'133	100'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 16.11.2023		5'396	25'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 16.11.2023		13'315	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 16.11.2023		2'025	25'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 16.11.2023		5'663	225'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		2'275'000	281'524	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 16.11.2023		300'000	37'124	CNY/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		2'668'446	4'000'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		233'489	350'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		466'667	700'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		90'000'000	60'932	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		46'962	70'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		10'000'000	6'721	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 17.11.2023		57'088	85'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		4'695'000'000	3'186'231	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 17.11.2023		410'000'000	278'244	KRW/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		29'966'801	5'050'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		2'063'400	16'850'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		10'735'778	9'725'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		571'568	4'425'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		60'729'808	63'075'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		7'396'608	11'450'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		1'137'918	2'150'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		223'231	2'750'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		1'019'146	20'225'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		24'050'555	196'400'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		638'359	16'300'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		4'384'177	7'625'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		77'243	925'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		373'772	650'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		121'862'834	137'575'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		525'636	800'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		829'362	33'600'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 18.01.2024		70'965	2'875'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		910'747	825'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		5'199'493	5'400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		92'621	175'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		2'551'887	430'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		86'923	1'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		522'182	2'400'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		53'849	1'375'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		629'910	975'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		43'515	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		10'452'346	11'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		18'267	225'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		904'061	10'825'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 18.01.2024		292'594	1'250'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		4'000'000	23'712	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		95'000'000	563'161	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'116'805	2'400'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		575'507	600'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		67'149	70'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		229'142	260'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		6'500'000	38'560	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		200'000	175'261	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		65'318	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		966	25'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		332'435	6'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		10'608	275'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		247'006	225'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		847'768	900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		5'987	75'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		27'445	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		238'207	40'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		16'645	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		100'069	175'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		152'263	175'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		56'574	9'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		9'479	75'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		16'050	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		783'067	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 18.01.2024		16'262	25'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		256'796	400'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		28'424	575'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		70'647	75'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 18.01.2024		13'364	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		2'616'392	3'025'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		439'482	400'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		237'854	275'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 18.01.2024		27'468	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'133'942	1'200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		94'495	100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		214'711	35'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		24'538	4'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		39'506	325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		9'117	75'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		87'125	150'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		14'521	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		10'548	125'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 18.01.2024		2'110	25'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		9'613	250'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 18.01.2024		1'923	50'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		22'523	450'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		2'503	50'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		177'895	275'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 18.01.2024		16'172	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 18.01.2024		4'128	50'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 18.01.2024		6'339	50'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 18.01.2024		5'452	25'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		50'000	1'244	THB/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		66'834	11'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 18.01.2024		25'000	5'907	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 18.01.2024		25'000	5'444	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		25'000	27'355	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 18.01.2024		50'000	6'345	DKK/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		32'452	650'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 18.01.2024		175'000	14'854	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		185'011	1'525'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		625'000	24'055	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 18.01.2024		50'000	4'160	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		225'000	145'383	CAD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		23'640	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		18'198	150'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 18.01.2024		25'000	13'424	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		275'000	10'584	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		175'000	151'417	USD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		374'444	7'500'000	CHF/MXN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		729'101	120'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 18.01.2024		150'000	86'962		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		775'000	19'200		THB/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		118'202	125'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		25'000	619		THB/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		3'576'184	4'175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 18.01.2024		500'000	12'320		THB/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		1'365'462	1'450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		784'839	130'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		1'197'309	9'975'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		625'000	582'700		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 18.01.2024		71'112	600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 18.01.2024		25'000	23'308		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.01.2024		63'875	75'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		3'211'143	4'750'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		277'172	410'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		324'934	490'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		26'525	40'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		59'783	90'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		5'978	9'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		10'000'000	6'689		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		140'000'000	93'645		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		5'190'000'000	3'347'221		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		449'000'000	289'577		KRW/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		578'264	4'625'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		125'039'655	146'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		91'970	175'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		773'207	33'000'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		4'464'472	7'900'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		42'349	200'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		24'371'630	205'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		18'410	225'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		524'044	2'475'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		11'092'224	12'975'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		11'147'484	10'300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		395'586	700'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		78'113	950'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		904'354	11'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		68'534	2'925'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		1'169'260	2'225'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		54'438	1'450'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		2'699'616	460'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		542'543	850'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		973'962	900'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		152'863	3'100'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		7'552'228	11'900'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		233'170	2'850'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		666'342	1'050'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		30'344'436	5'170'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		1'765'327	35'800'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		2'160'390	18'175'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		630'731	16'800'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'404'544	5'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		61'040'629	65'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		283'844	1'250'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		2'469	50'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		5'000'000	29'356		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		940	25'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		25'000	23'329		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 14.03.2024		75'000	47'962		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		125'000	14'875		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024		100'000	12'520		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		25'000	13'156		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		50'000	4'099		NOK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		21'384	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		50'000	10'607		PLN/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		2'058	25'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		25'000	21'581		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		225'000	143'778		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		25'000	15'975		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		1'500'000	74'768		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		450'000	388'825		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		175'000	151'210		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		325'000	26'681		NOK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		40'000'000	235'204	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		3'000'000	17'640	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		125'000	6'231	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		1'175'000	1'015'779	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		525'000	494'807	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		85'929	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		75'000'000	441'759	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		837'805	975'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		128'708	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		70'063	75'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		385'126	680'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		633'369	990'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		2'014'034	16'800'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		48'841	390'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		54'389	1'450'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'924'677	6'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		217'001	4'380'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		21'152	90'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		957'542	880'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		2'627'038	448'630'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		44'318	540'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		89'305	170'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		42'704	200'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		81'616	990'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		83'509	130'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		9'833'549	11'440'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		74'626	3'070'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		42'905	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		32'838	5'575'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		93'029	100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		86'045	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		1'376'016	1'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 14.03.2024		250'000	142'961	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		500'000	326'353	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		3'175'000	3'011'907	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 14.03.2024		475'000	529'277	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		194'925'000	1'149'506	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		75'000	40'216	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		8'150'000	7'204'771	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		7'825'000	958'242	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 14.03.2024		175'000	22'279	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 14.03.2024		25'000	6'030	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		375'000	14'018	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		1'050'000	53'746	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		100'000	8'304	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		75'000	16'379	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		500'000	41'866	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 14.03.2024		25'000	16'385	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		1'275'000	31'331	THB/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		703'748	120'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		138'920	125'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		27'784	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		16'306	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		12'202	325'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		3'195	25'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		10'654	125'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		13'615	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		57'650	100'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		2'458	100'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		94'850	775'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		2'131	25'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		2'816	75'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		544'622	4'450'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		22'010	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		58'646	10'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		2'333'243	2'450'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		25'632	500'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		2'531'098	2'875'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		13'615	25'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		12'816	250'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		119'043	125'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		14'413	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		2'094	25'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		10'446	425'000	CHF/THB		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		114'144	175'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		5'502	25'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 14.03.2024		35'152	275'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 14.03.2024		33'056	150'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.03.2024		667'255	600'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 14.03.2024		12'235	50'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		16'199	25'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 14.03.2024		761'346	1'175'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 14.03.2024		32'648	50'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 14.03.2024		31'913	850'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		47'637	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		10'897'182	12'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.03.2024		5'787'835	6'075'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		20'000	10'702		NZD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 14.03.2024		66'881	125'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		7'500'000	43'791		JPY/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 14.03.2024		50'969	600'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.03.2024		271'185	475'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		75'000	9'140		CNY/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 14.03.2024		47'526	1'950'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 14.03.2024		1'861'305	15'275'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		150'000	12'743		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		25'000	1'283		MXN/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.03.2024		110'322	2'150'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.03.2024		1'751'610	300'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 14.03.2024		12'461	150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2024		43'940	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		25'000	610		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 14.03.2024		1'900'000	46'776		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 14.03.2024		600'000	671'380		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		9'925'000	375'023		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.03.2024		1'175'000	44'398		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.03.2024		300'000'000	1'769'514		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 14.03.2024		500'000	42'877		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 14.03.2024		175'000	14'718		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.03.2024		12'025'000	1'475'468		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 14.03.2024		125'000	27'740		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2024		8'475'000	7'494'129		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 14.03.2024		125'000	67'519		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 14.03.2024		2'050'000	106'439		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.03.2024		3'900'000	3'737'721		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 14.03.2024		475'000	274'479		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.03.2024		675'000	440'483		CAD/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		3'342'508	5'200'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		289'256	450'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		11'591	18'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		325'930	503'550'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		184'700'000	122'724		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		6'579	10'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		26'316	40'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.03.2024		210'356	325'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		5'500'000	3'560		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		300'000'000	198'983		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		5'883'850'000	3'940'124		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.03.2024		172'500'000	115'515		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		143'826'627	164'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		3'956'325	4'525'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		72'585'295	75'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		1'984'381	2'075'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		34'134'355	5'730'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		923'355	155'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		13'079'781	11'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		335'379	300'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		8'860'169	13'675'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		242'966	375'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		27'706'329	227'075'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		762'588	6'250'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		261'677	3'150'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.04.2024		6'230	75'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		1'055'579	12'350'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		27'778	325'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 25.04.2024		651'092	5'075'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		13'205	350'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 25.04.2024		493'284	13'075'000		CHF/CZK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		606'511	2'725'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 25.04.2024		16'693	75'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 25.04.2024		608'090	925'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 25.04.2024		328'477	1'375'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		2'102'053	40'725'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		56'777	1'100'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		910'888	37'150'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		24'519	1'000'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		2'175'000	2'086'799	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		25'000	23'986	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		2'125'000	1'869'862	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		55'000'000	328'521	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		2'525'000	309'494	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		225'000	146'813	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		650'000	33'955	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		200'000	224'851	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		2'350'000	2'078'967	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		22'112	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		250'000	21'240	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		75'000	6'241	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.04.2024		50'000	11'135	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		325'000	16'971	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		30'000'000	176'788	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		1'000'000	962'503	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		75'000	9'685	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		7'875'000	968'625	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		75'000	84'457	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		100'000	12'300	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		325'000	12'366	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		175'000	114'236	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		575'000	14'131	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		375'000	337'459	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		22'497	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		75'000	73'194	EUR/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		24'398	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		35'000'000	208'770	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.04.2024		28'417	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		32'807	5'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		25'000	2'129	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		25'000	3'272	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		75'000	2'889	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		125'000	6'721	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		1'344	25'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		1'725'000	214'505	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		200'000	4'965	THB/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		621	25'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.04.2024		2'103	25'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		3'075'000	165'677	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 25.04.2024		125'000	30'689	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		1'025'000	39'332	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		225'000	18'647	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		1'650'000	9'828	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		950'000	79'905	SEK/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.04.2024		2'693	50'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		12'383	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 25.04.2024		75'000	49'990	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		680'000'000	4'050'413	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.04.2024		2'875'000	70'901	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		17'400'000	15'633'378	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 25.04.2024		375'000	48'843	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 25.04.2024		200'000	45'059	PLN/CHF		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.04.2024		1'232	50'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.04.2024		20'575'000	2'547'905	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		8'500'000	8'255'115	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		1'100'000	1'248'775	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		975'000	647'622	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		25'000	22'598	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'050'000	949'106	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.04.2024		125'000	83'608	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		6'235	50'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		25'000	24'477	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		50'000	1'930	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.04.2024		25'000	2'105	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		1'000'000	5'972	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		125'000	142'597	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.04.2024		50'000	4'247	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		225'000	12'228	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.04.2024		450'000	440'577	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		35'000'000	209'032	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2024		91'200	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.04.2024		40'000'000	236'280	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2024		1'700'000	1'550'407	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 25.04.2024		200'000	7'678	CZK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.04.2024		23'037	3'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.04.2024		175'000	198'570	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.04.2024		625'000	33'343	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.04.2024		16'488	25'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.04.2024		28'229	225'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.04.2024		48'485	50'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		5'197'041	9'000'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		129'926	225'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		1'316'209	2'450'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 26.04.2024		26'861	50'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		150'000	86'973	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		25'000	14'462	AUD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 26.04.2024		14'712	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		25'000	13'519	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 26.04.2024		175'000	94'051	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		675'000	395'918	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 26.04.2024		25'000	14'800	AUD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		3'939'518	5'900'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		113'512	170'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		8'000'000	5'342	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		160'000'000	107'962	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		23'396	35'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		2'005	3'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		450'000'000	302'013	KRW/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.04.2024		3'356	5'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		20'000'000	13'427	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		170'000'000	112'564	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.04.2024		5'305'000'000	3'512'663	KRW/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		126'639'787	139'650'000	CHF/USD		-1'023'204.46	-0.09	b)
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		4'733'561	8'050'000	CHF/AUD		-49'103.53	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		11'503'672	10'200'000	CHF/GBP		-173'319.28	-0.02	b)
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		28'535'451	4'845'000'000	CHF/JPY		263'618.56	0.02	b)
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		8'099'080	12'200'000	CHF/CAD		-22'437.83	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		62'521'881	64'350'000	CHF/EUR		-451'524.82	-0.04	b)
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		24'583'257	196'600'000	CHF/CNY		-232'601.89	-0.02	b)
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		445'497	11'600'000	CHF/CZK		-4'860.10	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		301'294	1'250'000	CHF/ILS		-5'085.17	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		599'293	4'600'000	CHF/DKK		-4'439.89	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		1'928'411	36'350'000	CHF/MXN		-13'216.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		938'963	11'200'000	CHF/SEK		4'931.21	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		567'088	850'000	CHF/SGD		-3'416.61	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		1'210'700	2'250'000	CHF/NZD		-6'479.59	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		831'870	33'950'000	CHF/THB		-6'265.36	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 30.05.2024		60'292	725'000	CHF/SEK		-169.60	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 30.05.2024		626'630	550'000	CHF/GBP		-3'019.06	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 30.05.2024		27'083	700'000	CHF/CZK		-94.29	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 30.05.2024		54'606	2'225'000	CHF/THB		-323.50	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 30.05.2024		608'616	11'475'000	CHF/MXN		-4'318.76	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 30.05.2024		2'635'794	21'000'000	CHF/CNY		-14'944.87	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 30.05.2024		24'174	100'000	CHF/ILS		-336.39	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 30.05.2024		515'615	775'000	CHF/CAD		-302.12	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 30.05.2024		1'890'918	325'000'000	CHF/JPY		-5'514.65	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 30.05.2024		12'007'110	13'225'000	CHF/USD		-82'724.26	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 30.05.2024		5'208'626	5'350'000	CHF/EUR		-26'937.05	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 30.05.2024		983'301	1'650'000	CHF/AUD		2'988.42	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 30.05.2024		39'174	300'000	CHF/DKK		-199.96	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 30.05.2024		33'411	50'000	CHF/SGD		-147.89	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 30.05.2024		40'644	75'000	CHF/NZD		71.24	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		551'003	2'450'000	CHF/PLN		-2'211.57	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 31.05.2024		39'416	175'000	CHF/PLN		-99.76	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		3'596'766	5'450'000'000	CHF/KRW		-13'360.06	0.00	b)
	CHF/KRW Verfall 31.05.2024		125'000'000	82'719	KRW/CHF		82.64	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 31.05.2024		211'508	320'000'000	CHF/KRW		-463.22	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-1'879'429.47	-0.17	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Swaps								-8'920'839.86	-0.82
09/27	IRS FIX LEG 2.41502% P.A. EUR	10'000	0	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
09/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-10'000	10'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
10/27	IRS FIX LEG 2.95% P.A. EUR	25'000	0	25'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
10/27	IRS FLOATING LEG - EURIBOR 6M EUR	-25'000	25'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
01/28	IRS FIX LEG 2.8012% P.A. EUR	15'000	0	15'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
01/28	IRS FLOATING LEG - EUR - EURO06M	-15'000	15'000	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
02/28	IRS FIX LEG 0.4725% P.A. JPY	3'000'000	0	1'000'000	2'000'000 JPY	99.92%	11'647'143.71	1.07	b)
02/28	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-3'000'000	1'000'000	0	-2'000'000 JPY	100.00	-11'656'340.00	-1.07	b)
07/28	IRS FIX LEG 0.2463% P.A. JPY	1'000'000	0	1'000'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
07/28	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'000'000	1'000'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
07/28	IRS FIX LEG 2.4355% P.A. CNY	150'000	0	0	150'000 CNY	101.36%	19'226'689.14	1.77	b)
07/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	-150'000	0	0	-150'000 CNY	100.00	-18'967'800.00	-1.74	b)
09/28	IRS FIX LEG 0.289% P.A. JPY	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
09/28	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-300'000	300'000	0	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/28	IRS FIX LEG 2.396% P.A. CNY	0	100'000	0	100'000 CNY	101.28%	12'806'490.60	1.18	b)
12/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	0	0	100'000	-100'000 CNY	100.00	-12'645'200.00	-1.16	b)
12/28	IRS FIX LEG 2.2925% P.A. CNY	0	80'000	0	80'000 CNY	100.80%	10'197'464.59	0.94	b)
12/28	IRS FLOATING LEG - CNY - CNRR007	0	0	80'000	-80'000 CNY	100.00	-10'116'160.00	-0.93	b)
01/29	IRS FIX LEG 2.335% P.A. EUR	0	28'000	0	28'000 EUR	97.56%	26'788'479.01	2.46	b)
01/29	IRS FLOATING LEG - EUR - ESTRON	0	0	28'000	-28'000 EUR	100.00	-27'458'700.08	-2.52	b)
03/29	IRS FIX LEG 0.5% P.A. JPY	0	0	3'809'000	-3'809'000 JPY	99.58%	-22'105'566.16	-2.03	b)
03/29	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	3'809'000	0	3'809'000 JPY	100.00	22'199'499.53	2.04	b)
05/30	IRS FIX LEG 3.10609% P.A. USD	15'000	0	0	15'000 USD	90.98%	12'516'378.72	1.15	b)
05/30	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-15'000	0	0	-15'000 USD	100.00	-13'757'250.00	-1.26	b)
01/33	IRS FIX LEG 0.79253% P.A. JPY	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.37%	5'791'321.17	0.53	b)
01/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-1'000'000	0	0	-1'000'000 JPY	100.00	-5'828'170.00	-0.54	b)
02/33	IRS FIX LEG 0.8555% P.A. JPY	1'250'000	0	0	1'250'000 JPY	99.81%	7'271'589.27	0.67	b)
02/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-1'250'000	0	0	-1'250'000 JPY	100.00	-7'285'212.50	-0.67	b)
07/33	IRS FIX LEG 3.55612% P.A. USD	15'000	0	0	15'000 USD	92.81%	12'767'772.73	1.17	b)
07/33	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-15'000	0	0	-15'000 USD	100.00	-13'757'250.00	-1.26	b)
09/33	IRS FIX LEG 0.8395% P.A. JPY	800'000	0	0	800'000 JPY	99.70%	4'648'637.77	0.43	b)
09/33	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	-800'000	0	0	-800'000 JPY	100.00	-4'662'536.00	-0.43	b)
11/33	IRS FIX LEG 0.12575% P.A. JPY	700'000	0	0	700'000 JPY	92.56%	3'776'140.60	0.35	b)
11/33	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-700'000	0	0	-700'000 JPY	100.00	-4'079'719.00	-0.38	b)
07/42	IRS FIX LEG 2.819% P.A. USD	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
07/42	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	-4'000	4'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/43	IRS FIX LEG 1.3375% P.A. JPY	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	98.70%	5'752'409.27	0.53	b)
01/43	IRS FLOATING LEG - JPY OIS TONAR	-1'000'000	0	0	-1'000'000 JPY	100.00	-5'828'170.00	-0.54	b)
02/43	IRS FIX LEG 1.26% P.A. JPY	1'500'000	0	0	1'500'000 JPY	97.25%	8'501'824.12	0.78	b)
02/43	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-1'500'000	0	0	-1'500'000 JPY	100.00	-8'742'255.00	-0.80	b)
03/43	IRS FIX LEG 3.4366% P.A. USD	7'500	0	0	7'500 USD	89.41%	6'149'874.42	0.57	b)
03/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'500	0	0	-7'500 USD	100.00	-6'878'625.00	-0.63	b)
09/43	IRS FIX LEG 4.1578% P.A. USD	17'500	0	0	17'500 USD	98.22%	15'764'249.69	1.45	b)
09/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-17'500	0	0	-17'500 USD	100.00	-16'050'125.00	-1.48	b)
10/43	IRS FIX LEG 4.618% P.A. USD	-17'500	17'500	0	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
10/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	17'500	0	17'500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/43	IRS FIX LEG 3.4793% P.A. USD	0	10'000	5'000	5'000 USD	89.35%	4'097'453.36	0.38	b)
12/43	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	0	5'000	10'000	-5'000 USD	100.00	-4'585'750.00	-0.42	b)
01/44	IRS FIX LEG 1.34875% P.A. JPY	0	500'000	0	500'000 JPY	98.13%	2'859'666.59	0.26	b)
01/44	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	500'000	-500'000 JPY	100.00	-2'914'085.00	-0.27	b)
03/44	IRS FIX LEG 1.34125% P.A. JPY	0	1'050'000	0	1'050'000 JPY	97.72%	5'980'271.74	0.55	b)
03/44	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'050'000	-1'050'000 JPY	100.00	-6'119'578.50	-0.56	b)
10/48	IRS FIX LEG 0.911% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	86.38%	1'258'591.67	0.12	b)
10/48	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'457'042.50	-0.13	b)
12/48	IRS FIX LEG 1.405% P.A. JPY	0	1'200'000	0	1'200'000 JPY	96.57%	6'753'799.09	0.62	b)
12/48	IRS FLOATING LEG - JPY - TONA-OIS-COMPOUND	0	0	1'200'000	-1'200'000 JPY	100.00	-6'993'804.00	-0.64	b)
02/50	IRS FIX LEG 0.2445% P.A. JPY	250'000	0	0	250'000 JPY	70.41%	1'025'852.53	0.09	b)
02/50	FLOATING LEG (JPY-TONA-OIS-COMPOUND)	-250'000	0	0	-250'000 JPY	100.00	-1'457'042.50	-0.13	b)
07/51	IRS FIX LEG 0.36451% P.A. JPY	350'000	0	0	350'000 JPY	71.68%	1'462'105.53	0.13	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
07/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONAR	-350'000	0	0	-350'000 JPY	100.00	-2'039'859.50	-0.19	b)
11/51	IRS FIX LEG 0.47% P.A. JPY	200'000	0	0	200'000 JPY	73.71%	859'181.99	0.08	b)
11/51	IRS FLOATING LEG - JPY-TONA-OIS-COMPOUND	-200'000	0	0	-200'000 JPY	100.00	-1'165'634.00	-0.11	b)
02/53	IRS FIX LEG 1.31% P.A. JPY	500'000	0	0	500'000 JPY	92.35%	2'691'177.38	0.25	b)
02/53	IRS FLOATING LEG - JPY - MUTKCALM	-500'000	0	0	-500'000 JPY	100.00	-2'914'085.00	-0.27	b)
04/53	IRS FIX LEG 2.967% P.A. USD	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
04/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-4'000	4'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/53	IRS FIX LEG 3.21718% P.A. USD	7'500	0	0	7'500 USD	84.20%	5'791'557.70	0.53	b)
06/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'500	0	0	-7'500 USD	100.00	-6'878'625.00	-0.63	b)
08/53	IRS FIX LEG 3.56724% P.A. USD	16'000	0	0	16'000 USD	90.74%	13'315'688.28	1.22	b)
08/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-16'000	0	0	-16'000 USD	100.00	-14'674'400.00	-1.35	b)
09/53	IRS FIX LEG 3.9383% P.A. USD	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
09/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-7'000	7'000	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/53	IRS FIX LEG 4.29579% P.A. USD	5'500	0	0	5'500 USD	103.90%	5'241'159.68	0.48	b)
11/53	IRS FLOATING LEG - USD - SOFR-COMPOUND	-5'500	0	0	-5'500 USD	100.00	-5'044'325.00	-0.46	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	77'789'022.41	7.15
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'012'968'461.37	93.12
Derivative Finanzinstrumente	-10'800'269.33	-0.99
Sonstige Vermögenswerte	7'901'772.53	0.73
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'087'858'986.98	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'818'071.85	
Andere Verbindlichkeiten	-22'684.54	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'086'018'230.59	

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);	1'012'968'461.37	93.12
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-11'073'914.34	-1.02
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Collateral Accounts

OTC COLLATERAL IV-BFNINT JPY ZKB	1'521'248'000 JPY	8'866'091.96
----------------------------------	-------------------	--------------

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59555135
CAD	1 = CHF	0.66757652
CNY	1 = CHF	0.12645200
CZK	100 = CHF	3.89529900
DKK	100 = CHF	13.14844400
EUR	1 = CHF	0.98066786
GBP	1 = CHF	1.14840937
HUF	100 = CHF	0.25088900
ILS	1 = CHF	0.24572332
JPY	100 = CHF	0.58281700
KRW	1 = CHF	0.00066359
MXN	1 = CHF	0.05382810
NOK	100 = CHF	8.28190000
NZD	1 = CHF	0.54272351
PLN	1 = CHF	0.22666387
SEK	100 = CHF	8.35603500
SGD	1 = CHF	0.67252062
THB	100 = CHF	2.47477100
USD	1 = CHF	0.91715000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	230'892'844.13	21.260
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	334'356'256.89	30.787

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
GTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	-	-	-	-
Swiss Red Cross	CHF	-	-	-	-

6 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	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.500	0.750	0.400	0.100	2.000
GT CHF	0.400	0.650	0.300	0.100	2.000
GTH1 CHF	0.400	0.700	0.300	0.100	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	2.000
Swiss Red Cross	0.700	0.900	0.500	0.200	2.000

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

8 Benchmark

Bloomberg Global Aggregate TR Index Unhedged CHF

9 TER

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

10 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert 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 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder 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, 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 Markttrendite 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 im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben 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.
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 2% 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 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 modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

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 § 19 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 Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem 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 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 Quoten am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.