

SWISSCANTO (CH) BOND FUND SUSTAINABLE CHF

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
AA CHF	32517285	CHF
BA CHF	42967257	CHF
CT CHF	37873456	CHF
DT CHF	24542672	CHF
GT CHF	32517286	CHF
NT CHF	3433555	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	21
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	21
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
7	Pauschale Verwaltungskommission	22
8	Benchmark	22
9	TER	22
10	Fussnoten	23
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24

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		3'727'612'187.08	3'596'400'249.72	2'131'455'556.11	1'745'881'904.78
Klasse AA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'598'084.79	11'337'269.13	4'826'328.12	3'416'901.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		158'660.588	126'810.422	55'485.112	35'052.404
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.0083	89.4033	86.9842	97.4798
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		91.7782	89.1619	87.2626	97.4018
Ausschüttung je Anteil		-	0.15	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.85 %	0.85 %	0.85 %	0.85 %
Klasse BA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'379'119.12	5'753'943.43	3'044'523.12	3'994'462.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		77'314.864	61'917.705	33'706.366	39'588.963
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.4424	92.9289	90.3249	100.8984
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.2038	92.6780	90.6139	100.8177
Ausschüttung je Anteil		-	0.50	0.20	-
Total Expense Ratio (TER)		0.53 %	0.53 %	0.53 %	0.53 %
Klasse CT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		31'415'825.42	30'922'435.08	25'351'514.92	23'296'438.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		330'218.202	335'021.005	283'185.260	232'944.513
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.1366	92.3000	89.5227	100.0085
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		94.8987	92.0508	89.8092	99.9285
Thesaurierung je Anteil		-	0.50	0.12	0.12
Total Expense Ratio (TER)		0.49 %	0.49 %	0.49 %	0.49 %
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		190'529'270.82	191'667'885.81	144'122'027.50	127'993'786.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'912'628.401	1'983'477.076	1'538'589.351	1'223'850.038
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.6165	96.6323	93.6715	104.5829
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.3674	96.3714	93.9713	104.4992
Thesaurierung je Anteil		-	0.61	0.21	0.23
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'159'092'894.15	2'136'619'465.64	1'475'121'714.79	1'132'914'429.11
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		22'550'258.285	23'005'430.022	16'387'031.175	11'273'849.216
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.7458	92.8746	90.0176	100.4905
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.5065	92.6238	90.3057	100.4101
Thesaurierung je Anteil		-	0.61	0.22	0.24
Total Expense Ratio (TER)		0.38 %	0.38 %	0.38 %	0.38 %

Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'324'596'992.78	1'220'099'250.63	478'989'447.66	454'265'887.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'099'550.353	1'044'762.292	424'188.090	361'248.054
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	1'204.6715	1'167.8247	1'129.1912	1'257.4902
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	1'201.6598	1'164.6716	1'132.8046	1'256.4842
Thesaurierung je Anteil	-	12.04	7.41	7.87
Total Expense Ratio (TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	3.10 %	7.42 %	-12.35 %	-2.51 %
Klasse BA CHF	3.27 %	7.76 %	-12.07 %	-2.19 %
Klasse CT CHF	3.29 %	7.80 %	-12.04 %	-2.15 %
Klasse DT CHF	3.31 %	7.26 %	-11.68 %	-2.07 %
Klasse GT CHF	3.32 %	7.28 %	-11.66 %	-2.05 %
Klasse NT CHF	3.52 %	7.68 %	-11.32 %	-1.67 %
Benchmark	3.32 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	-	0.39 %	0.60 %	0.27 %

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 AA CHF	-0.22 %
Klasse BA CHF	-0.05 %
Klasse CT CHF	-0.03 %
Klasse DT CHF	-0.01 %
Klasse GT CHF	-
Klasse NT CHF	0.20 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wo bei 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 Klass enwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.04.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	0.00	59'751'597.78
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'715'496'045.00	3'513'839'028.18
Derivative Finanzinstrumente	0.00	-891'101.55
Sonstige Vermögenswerte	32'406'168.58	24'499'529.17
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'747'902'213.58	3'597'199'053.58
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-19'452'405.65	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-837'620.85	-798'803.86
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'727'612'187.08	3'596'400'249.72

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		126'810.422	55'485.112
Ausgegebene Anteile		36'136.519	99'102.470
Zurückgenommene Anteile		-4'286.353	-27'777.160
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		158'660.588	126'810.422
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		61'917.705	33'706.366
Ausgegebene Anteile		24'249.155	37'402.986
Zurückgenommene Anteile		-8'851.996	-9'191.647
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		77'314.864	61'917.705
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		335'021.005	283'185.260
Ausgegebene Anteile		49'235.835	103'601.240
Zurückgenommene Anteile		-54'038.638	-51'765.495
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		330'218.202	335'021.005
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'983'477.076	1'538'589.351
Ausgegebene Anteile		262'147.826	2'005'436.716
Zurückgenommene Anteile		-332'996.501	-1'560'548.991
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'912'628.401	1'983'477.076
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		23'005'430.022	16'387'031.175
Ausgegebene Anteile		3'124'034.414	10'917'813.238
Zurückgenommene Anteile		-3'579'206.151	-4'299'414.391
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		22'550'258.285	23'005'430.022
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'044'762.292	424'188.090
Ausgegebene Anteile		115'829.869	622'357.474
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		7'749.632	40'156.147
Zurückgenommene Anteile		-68'791.440	-41'939.419
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'099'550.353	1'044'762.292

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	13.12.2023	2'638'580.02	2'191.926
Klasse NT CHF	13.12.2023	6'690'213.09	5'557.706

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'596'400'249.72	2'131'455'556.11
Ausbezahlte Ausschüttung		-51'992.24	-9'288.97
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-9'675'845.61	-4'168'786.54
Saldo aus dem Anteilverkehr		19'842'794.11	1'367'474'013.54
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		121'096'981.10	101'648'755.58
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'727'612'187.08	3'596'400'249.72

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		75'289.08	85'368.90
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		22'522'777.58	33'586'578.60
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'127'578.15	4'151'380.39
Total Ertrag		23'725'644.81	37'823'327.89
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-4'573'806.57	-8'427'938.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-850'469.58	-1'284'242.32
Total Aufwand		-5'424'276.15	-9'712'180.33
Nettoertrag / Verlust		18'301'368.66	28'111'147.56
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-6'038'799.34	-42'872'023.66
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		1'634'499.12	4'523'637.87
Realisierter Erfolg		13'897'068.44	-10'237'238.23
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		107'199'912.66	111'885'993.81
Gesamterfolg		121'096'981.10	101'648'755.58

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							3'715'496'045.00	99.14	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							3'715'496'045.00	99.14	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	95.35%	2'193'050.00	0.06	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	500	6'500 CHF	96.10%	6'246'500.00	0.17	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	98.70%	4'935'000.00	0.13	a)
AE							13'374'550.00	0.36	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	2'150	0	0	2'150 CHF	109.30%	2'349'950.00	0.06	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'240	0	0	1'240 CHF	122.00%	1'512'800.00	0.04	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	8'700	1'530	0	10'230 CHF	100.70%	10'301'610.00	0.27	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	89.25%	2'231'250.00	0.06	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	103.55%	3'624'250.00	0.10	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	3'000	0	0	3'000 CHF	101.33%	3'039'900.00	0.08	a)
AT							23'059'760.00	0.62	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	395	395	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	98.25%	4'912'500.00	0.13	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	5'250	0	5'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	0.03	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'500	300	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'500	640	0	2'140 CHF	96.90%	2'073'660.00	0.06	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	3'500	5'250	0	8'750 CHF	96.10%	8'408'750.00	0.22	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	92.50%	2'775'000.00	0.07	a)
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	6'140	0	6'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.75%	10'175'000.00	0.27	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	5'000	0	0	5'000 CHF	103.50%	5'175'000.00	0.14	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	103.45%	2'069'000.00	0.06	a)
AU							36'579'410.00	0.98	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	1'000	0	0	1'000 CHF	91.40%	914'000.00	0.02	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	94.65%	2'839'500.00	0.08	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	95.65%	956'500.00	0.03	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	2'500	0	0	2'500 CHF	89.55%	2'238'750.00	0.06	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	4'500	0	0	4'500 CHF	96.40%	4'338'000.00	0.12	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	11'000	205	0	11'205 CHF	93.20%	10'443'060.00	0.28	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	11'000	0	0	11'000 CHF	93.65%	10'301'500.00	0.27	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.03	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	3'200	0	0	3'200 CHF	98.90%	3'164'800.00	0.08	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	7'500	0	0	7'500 CHF	96.70%	7'252'500.00	0.19	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.85%	10'185'000.00	0.27	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	103.05%	8'244'000.00	0.22	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.95%	5'147'500.00	0.14	a)
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	5'500	0	0	5'500 CHF	102.10%	5'615'500.00	0.15	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.50%	10'250'000.00	0.27	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	20'000	0	0	20'000 CHF	102.45%	20'490'000.00	0.55	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.25%	2'025'000.00	0.05	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	103.90%	6'234'000.00	0.17	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	3'000	0	0	3'000 CHF	105.35%	3'160'500.00	0.08	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	14'500	0	0	14'500 CHF	102.05%	14'797'250.00	0.39	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	5'000	0	1'750	3'250 CHF	101.25%	3'290'625.00	0.09	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	5'000	1'750	0	6'750 CHF	102.75%	6'935'625.00	0.19	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.65%	5'132'500.00	0.14	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	100.40%	7'028'000.00	0.19	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.
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.91%	4'995'300.00	0.13	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	99.84%	5'990'100.00	0.16	a)
CH1342764060	1.3675 % Q 1.3675 04/26/34 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	99.72%	4'986'100.00	0.13	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	3'000	0	3'000 CHF	100.27%	3'008'070.00	0.08	a)
CA							170'908'680.00	4.56	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	650	0	0	650 CHF	174.70%	1'135'550.00	0.03	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	5'000	0	1'000	4'000 CHF	101.09%	4'043'600.00	0.11	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	2'000	0	0	2'000 CHF	120.08%	2'401'600.00	0.06	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	23'000	0	0	23'000 CHF	100.07%	23'016'100.00	0.61	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'215	0	0	1'215 CHF	101.08%	1'228'122.00	0.03	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	2'000	0	0	2'000 CHF	103.80%	2'076'000.00	0.06	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	10'000	5'400	0	15'400 CHF	103.51%	15'940'540.00	0.43	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	48'000	0	3'100	44'900 CHF	103.53%	46'484'970.00	1.24	a)
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	0	7'720	0	7'720 CHF	103.21%	7'967'812.00	0.21	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	4'400	0	0	4'400 CHF	108.07%	4'755'080.00	0.13	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	25'000	0	0	25'000 CHF	110.22%	27'555'000.00	0.74	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	1'500	0	0	1'500 CHF	112.98%	1'694'700.00	0.05	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	2'475	0	0	2'475 CHF	106.56%	2'637'360.00	0.07	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	2'000	3'200	4'140	1'060 CHF	100.10%	1'061'060.00	0.03	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	240	0	240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	0	3'100	0	3'100 CHF	100.07%	3'102'170.00	0.08	a)
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	7'000	0	4'000	3'000 CHF	100.12%	3'003'600.00	0.08	a)
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	1'000	0	0	1'000 CHF	100.64%	1'006'400.00	0.03	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	7'800	3'000	0	10'800 CHF	101.80%	10'994'400.00	0.29	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	6'200	0	5'000	1'200 CHF	102.15%	1'225'800.00	0.03	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	700	0	0	700 CHF	100.65%	704'550.00	0.02	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	4'000	500	0	4'500 CHF	100.81%	4'536'450.00	0.12	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	7'090	0	7'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	0	4'000	0	4'000 CHF	100.58%	4'023'200.00	0.11	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'000	1'000	1'000	1'000 CHF	100.18%	1'001'800.00	0.03	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	6'500	0	6'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	18'700	0	0	18'700 CHF	99.96%	18'692'520.00	0.50	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	7'000	0	2'300	4'700 CHF	106.60%	5'010'200.00	0.13	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	8'000	0	2'800	5'200 CHF	104.20%	5'418'400.00	0.14	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'135	0	2'135	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	10'000	0	5'000	5'000 CHF	102.30%	5'115'000.00	0.14	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	1'400	0	0	1'400 CHF	108.95%	1'525'300.00	0.04	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	8'000	0	0	8'000 CHF	150.23%	12'018'400.00	0.32	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	8'550	0	0	8'550 CHF	96.15%	8'220'825.00	0.22	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	4'000	0	0	4'000 CHF	107.05%	4'282'000.00	0.11	a)
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'000	1'200	0	5'200 CHF	100.10%	5'205'200.00	0.14	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLIL 2 3/8 12/10/26	0	3'000	0	3'000 CHF	102.00%	3'060'000.00	0.08	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	3'250	0	1'300	1'950 CHF	100.62%	1'962'090.00	0.05	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSN VX 1 3/4 02/27/24	12'475	0	12'475	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVN VX 1 3/4 03/19/24	12'000	0	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	0	7'720	7'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	2'000	0	0	2'000 CHF	100.01%	2'000'200.00	0.05	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'050	1'000	1'000	1'050 CHF	100.78%	1'058'190.00	0.03	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURN VX 1 1/2 07/22/26	2'000	0	0	2'000 CHF	100.20%	2'004'000.00	0.05	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	4'700	0	0	4'700 CHF	101.80%	4'784'600.00	0.13	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 07/14/26	1'500	0	0	1'500 CHF	100.15%	1'502'250.00	0.04	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.
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	100.65%	1'006'500.00	0.03 a)	
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	14'000	0	9'000	5'000 CHF	99.81%	4'990'500.00	0.13 a)	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	3'000	0	0	3'000 CHF	100.09%	3'002'700.00	0.08 a)	
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	3'000	0	0	3'000 CHF	99.84%	2'995'200.00	0.08 a)	
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	20'000	0	10'000	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.27 a)	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'575	0	0	1'575 CHF	99.50%	1'567'125.00	0.04 a)	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	0	1'300	0	1'300 CHF	99.30%	1'290'900.00	0.03 a)	
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	5'000	0	0	5'000 CHF	99.70%	4'985'000.00	0.13 a)	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	1'740	0	1'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	0	1'300	0	1'300 CHF	100.25%	1'303'250.00	0.03 a)	
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	0	700	0	700 CHF	99.60%	697'200.00	0.02 a)	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	550	0	0	550 CHF	100.55%	553'025.00	0.01 a)	
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	1'800	0	0	1'800 CHF	99.49%	1'790'820.00	0.05 a)	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	8'350	0	8'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	3'000	0	0	3'000 CHF	99.58%	2'987'400.00	0.08 a)	
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	2'425	0	0	2'425 CHF	98.45%	2'387'412.50	0.06 a)	
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	7'000	0	0	7'000 CHF	99.56%	6'969'200.00	0.19 a)	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	32'700	0	5'700	27'000 CHF	98.61%	26'624'700.00	0.71 a)	
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	5'000	0	0	5'000 CHF	95.40%	4'770'000.00	0.13 a)	
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	1'325	0	0	1'325 CHF	94.72%	1'255'040.00	0.03 a)	
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	4'715	0	0	4'715 CHF	95.99%	4'525'928.50	0.12 a)	
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	3'500	0	0	3'500 CHF	93.45%	3'270'750.00	0.09 a)	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	7'500	0	5'000	2'500 CHF	96.40%	2'410'000.00	0.06 a)	
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	4'000	0	0	4'000 CHF	95.60%	3'824'000.00	0.10 a)	
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	5'400	0	5'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	0	1'000	0	1'000 CHF	96.79%	967'900.00	0.03 a)	
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	1'000	0	0	1'000 CHF	99.75%	997'500.00	0.03 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	0.04 a)	
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	3'000	0	2'500	500 CHF	96.45%	482'250.00	0.01 a)	
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	2'100	0	0	2'100 CHF	97.65%	2'050'650.00	0.05 a)	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	500	0	0	500 CHF	93.30%	466'500.00	0.01 a)	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	640	640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	2'500	0	0	2'500 CHF	98.80%	2'470'000.00	0.07 a)	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	0	550	0	550 CHF	93.07%	511'885.00	0.01 a)	
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	1'000	0	0	1'000 CHF	93.15%	931'500.00	0.02 a)	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	0	2'000	0	2'000 CHF	99.37%	1'987'400.00	0.05 a)	
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	6'500	0	0	6'500 CHF	97.86%	6'360'900.00	0.17 a)	
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	1'000	0	0	1'000 CHF	94.90%	949'000.00	0.03 a)	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	17'955	0	0	17'955 CHF	95.13%	17'080'591.50	0.46 a)	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	2'500	1'600	0	4'100 CHF	99.24%	4'068'840.00	0.11 a)	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	0	10'000	0	10'000 CHF	95.43%	9'543'000.00	0.25 a)	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	4'500	420	0	4'920 CHF	95.84%	4'715'328.00	0.13 a)	
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	1'500	0	0	1'500 CHF	99.25%	1'488'750.00	0.04 a)	
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	2'500	420	0	2'920 CHF	94.75%	2'766'700.00	0.07 a)	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'500	0	0	2'500 CHF	96.06%	2'401'500.00	0.06 a)	
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	16'000	0	0	16'000 CHF	91.11%	14'577'600.00	0.39 a)	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	4'000	0	0	4'000 CHF	97.62%	3'904'800.00	0.10 a)	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.65%	956'500.00	0.03 a)	
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	5'000	1'565	0	6'565 CHF	99.98%	6'563'687.00	0.18 a)	
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'400	0	0	1'400 CHF	89.70%	1'255'800.00	0.03 a)	
CH0317921663	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 03/31/28	0	570	570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	3'250	3'500	1'000	5'750 CHF	96.87%	5'570'025.00	0.15 a)	
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	1'500	0	1'500 CHF	94.98%	1'424'700.00	0.04 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.
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	9'300	0	0	9'300 CHF	92.61%	8'612'730.00	0.23	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	2'000	0	0	2'000 CHF	89.90%	1'798'000.00	0.05	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	0	275	275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	1'700	0	0	1'700 CHF	95.79%	1'628'430.00	0.04	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	3'000	0	0	3'000 CHF	83.20%	2'496'000.00	0.07	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	3'000	0	0	3'000 CHF	95.70%	2'871'000.00	0.08	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	2'000	0	0	2'000 CHF	91.50%	1'830'000.00	0.05	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	2'500	0	0	2'500 CHF	83.02%	2'075'500.00	0.06	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	15'750	0	0	15'750 CHF	79.96%	12'593'700.00	0.34	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	4'000	0	0	4'000 CHF	96.50%	3'860'000.00	0.10	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	2'500	0	0	2'500 CHF	91.16%	2'279'000.00	0.06	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	3'500	0	0	3'500 CHF	96.87%	3'390'450.00	0.09	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	5'000	0	3'000	2'000 CHF	89.93%	1'798'600.00	0.05	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	7'000	0	0	7'000 CHF	81.77%	5'723'900.00	0.15	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	3'145	0	0	3'145 CHF	86.45%	2'718'852.50	0.07	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	500	0	0	500 CHF	82.80%	414'000.00	0.01	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	4'100	0	500	3'600 CHF	96.60%	3'477'600.00	0.09	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'600	0	0	1'600 CHF	91.30%	1'460'800.00	0.04	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	17'500	6'000	7'500	16'000 CHF	99.23%	15'876'800.00	0.42	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	5'000	0	0	5'000 CHF	95.75%	4'787'500.00	0.13	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	10'500	0	0	10'500 CHF	96.06%	10'086'300.00	0.27	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'450	500	0	1'950 CHF	96.42%	1'880'190.00	0.05	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	0	640	0	640 CHF	90.53%	579'392.00	0.02	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	2'000	0	0	2'000 CHF	96.88%	1'937'600.00	0.05	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	2'500	305	0	2'805 CHF	98.20%	2'754'510.00	0.07	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLLI 2 12/11/23	2'000	2'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	15'050	0	4'000	11'050 CHF	99.48%	10'992'540.00	0.29	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	4'000	1'000	0	5'000 CHF	96.83%	4'841'500.00	0.13	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	3'945	980	0	4'925 CHF	99.90%	4'920'075.00	0.13	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	4'000	0	0	4'000 CHF	93.25%	3'730'000.00	0.10	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	5'900	0	500	5'400 CHF	96.10%	5'189'400.00	0.14	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNIX 0 3/4 11/24/33	2'800	0	0	2'800 CHF	92.50%	2'590'000.00	0.07	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	1'000	0	0	1'000 CHF	93.35%	933'500.00	0.02	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'000	0	0	3'000 CHF	96.10%	2'883'000.00	0.08	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	2'500	0	0	2'500 CHF	96.77%	2'419'250.00	0.06	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	7'500	0	0	7'500 CHF	98.10%	7'357'500.00	0.20	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	9'900	0	0	9'900 CHF	98.80%	9'781'200.00	0.26	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	4'600	0	1'000	3'600 CHF	96.34%	3'468'240.00	0.09	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	5'000	0	0	5'000 CHF	96.30%	4'815'000.00	0.13	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	3'000	0	0	3'000 CHF	90.55%	2'716'500.00	0.07	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	2'500	1'000	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	12'000	4'250	0	16'250 CHF	96.55%	15'689'375.00	0.42	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	7'600	0	4'250	3'350 CHF	94.60%	3'169'100.00	0.08	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNIX 0 1/2 12/18/24	0	3'715	0	3'715 CHF	99.40%	3'692'710.00	0.10	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	2'200	0	0	2'200 CHF	97.10%	2'136'200.00	0.06	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	2'000	0	0	2'000 CHF	95.20%	1'904'000.00	0.05	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	8'000	0	0	8'000 CHF	94.71%	7'576'800.00	0.20	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'900	0	0	1'900 CHF	98.90%	1'879'100.00	0.05	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNIX 1 10/30/28 0	1'000	0	0	1'000 CHF	98.00%	980'000.00	0.03	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	0	3'000	0	3'000 CHF	99.35%	2'980'500.00	0.08	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'500	1'000	5'000	1'500 CHF	96.69%	1'450'350.00	0.04	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	2'250	0	0	2'250 CHF	91.60%	2'061'000.00	0.05	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	980	0	0	980 CHF	96.40%	944'720.00	0.03	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	98.05%	6'863'500.00	0.18	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNIX 0 3/8 04/09/25	0	2'000	0	2'000 CHF	98.91%	1'978'200.00	0.05	a)
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	5'000	0	0	5'000 CHF	99.91%	4'995'500.00	0.13	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.
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	3'200	0	0	3'200 CHF	96.35%	3'083'200.00	0.08 a)	
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	10'000	0	0	10'000 CHF	97.85%	9'785'000.00	0.26 a)	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	5'000	0	0	5'000 CHF	94.74%	4'737'000.00	0.13 a)	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'000	0	0	1'000 CHF	94.15%	941'500.00	0.03 a)	
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	17'700	0	0	17'700 CHF	95.10%	16'832'700.00	0.45 a)	
CH0419040982	0.5000 % SCMNXX 0 1/2 03/15/29	1'000	0	0	1'000 CHF	95.35%	953'500.00	0.03 a)	
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	2'500	2'000	0	4'500 CHF	99.34%	4'470'300.00	0.12 a)	
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'900	0	0	3'900 CHF	94.00%	3'666'000.00	0.10 a)	
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	300	0	0	300 CHF	91.45%	274'350.00	0.01 a)	
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	0	640	0	640 CHF	93.65%	599'360.00	0.02 a)	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	5'000	0	0	5'000 CHF	84.75%	4'237'500.00	0.11 a)	
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	3'370	0	0	3'370 CHF	86.45%	2'913'365.00	0.08 a)	
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	0	710	0	710 CHF	81.85%	581'135.00	0.02 a)	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	3'000	0	0	3'000 CHF	96.21%	2'886'300.00	0.08 a)	
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	10'500	0	0	10'500 CHF	99.81%	10'480'050.00	0.28 a)	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	5'000	0	2'000	3'000 CHF	96.14%	2'884'200.00	0.08 a)	
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	8'000	1'500	0	9'500 CHF	96.99%	9'214'050.00	0.25 a)	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	3'000	0	0	3'000 CHF	94.20%	2'826'000.00	0.08 a)	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	10'000	0	0	10'000 CHF	92.70%	9'270'000.00	0.25 a)	
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	15'750	0	0	15'750 CHF	89.53%	14'100'975.00	0.38 a)	
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	57'500	0	0	57'500 CHF	110.65%	63'623'750.00	1.70 a)	
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	3'000	0	0	3'000 CHF	93.95%	2'818'500.00	0.08 a)	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	2'000	0	0	2'000 CHF	86.95%	1'739'000.00	0.05 a)	
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	5'220	0	0	5'220 CHF	98.41%	5'137'002.00	0.14 a)	
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	19'500	275	0	19'775 CHF	91.10%	18'015'025.00	0.48 a)	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'000	0	0	1'000 CHF	93.85%	938'500.00	0.03 a)	
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	0	2'000	0	2'000 CHF	93.65%	1'873'000.00	0.05 a)	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'000	0	0	6'000 CHF	94.15%	5'649'000.00	0.15 a)	
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	0	1'240	0	1'240 CHF	98.46%	1'220'904.00	0.03 a)	
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	1'500	280	0	1'780 CHF	92.08%	1'639'024.00	0.04 a)	
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	11'200	4'000	2'500	12'700 CHF	89.10%	11'315'700.00	0.30 a)	
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	5'000	0	0	5'000 CHF	84.30%	4'215'000.00	0.11 a)	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	12'000	0	0	12'000 CHF	70.75%	8'490'000.00	0.23 a)	
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	5'000	0	0	5'000 CHF	86.95%	4'347'500.00	0.12 a)	
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'000	0	0	1'000 CHF	63.55%	635'500.00	0.02 a)	
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.05%	920'500.00	0.02 a)	
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	4'595	0	0	4'595 CHF	95.00%	4'365'250.00	0.12 a)	
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	20'800	0	0	20'800 CHF	91.25%	18'980'000.00	0.51 a)	
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'250	0	0	1'250 CHF	94.55%	1'181'875.00	0.03 a)	
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	5'400	0	0	5'400 CHF	85.55%	4'619'700.00	0.12 a)	
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	10'000	0	0	10'000 CHF	89.70%	8'970'000.00	0.24 a)	
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	98.00%	2'940'000.00	0.08 a)	
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	15'000	0	0	15'000 CHF	91.50%	13'725'000.00	0.37 a)	
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	0	0	8'000 CHF	97.05%	7'764'000.00	0.21 a)	
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	17'500	0	0	17'500 CHF	102.65%	17'963'750.00	0.48 a)	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	4'000	0	0	4'000 CHF	95.09%	3'803'600.00	0.10 a)	
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	18'300	0	0	18'300 CHF	74.15%	13'569'450.00	0.36 a)	
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	6'000	0	0	6'000 CHF	80.25%	4'815'000.00	0.13 a)	
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	3'000	0	0	3'000 CHF	78.60%	2'358'000.00	0.06 a)	
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	5'700	0	5'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'400	0	0	2'400 CHF	87.21%	2'093'040.00	0.06 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.
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	12'000	0	0	12'000 CHF	94.68%	11'361'600.00	0.30	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	4'900	0	0	4'900 CHF	84.90%	4'160'100.00	0.11	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.05%	2'971'500.00	0.08	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	5'000	0	0	5'000 CHF	93.85%	4'692'500.00	0.13	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	5'500	0	0	5'500 CHF	98.58%	5'421'900.00	0.14	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	97.10%	4'855'000.00	0.13	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	4'000	600	0	4'600 CHF	94.80%	4'360'800.00	0.12	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	500	0	0	500 CHF	83.70%	418'500.00	0.01	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	3'800	0	1'500	2'300 CHF	80.34%	1'847'820.00	0.05	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	5'000	0	0	5'000 CHF	99.12%	4'956'000.00	0.13	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	24'000	0	10'000	14'000 CHF	92.60%	12'964'000.00	0.35	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	7'000	0	0	7'000 CHF	94.87%	6'640'900.00	0.18	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	1'500	0	0	1'500 CHF	80.47%	1'207'050.00	0.03	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	6'500	0	0	6'500 CHF	90.30%	5'869'500.00	0.16	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	3'000	0	0	3'000 CHF	88.80%	2'664'000.00	0.07	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	21'250	0	0	21'250 CHF	92.37%	19'628'625.00	0.52	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	4'000	0	0	4'000 CHF	80.95%	3'238'000.00	0.09	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	5'800	0	0	5'800 CHF	88.60%	5'138'800.00	0.14	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	14'800	0	0	14'800 CHF	92.90%	13'749'200.00	0.37	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	200	0	0	200 CHF	94.50%	189'000.00	0.01	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	7'000	0	0	7'000 CHF	87.95%	6'156'500.00	0.16	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	14'750	0	0	14'750 CHF	93.87%	13'845'825.00	0.37	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	8'000	0	6'400	1'600 CHF	88.20%	1'411'200.00	0.04	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	11'700	0	0	11'700 CHF	84.45%	9'880'650.00	0.26	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	0	2'000	0	2'000 CHF	90.87%	1'817'400.00	0.05	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	86.85%	4'342'500.00	0.12	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	3'000	0	0	3'000 CHF	77.68%	2'330'400.00	0.06	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	4'200	0	0	4'200 CHF	87.80%	3'687'600.00	0.10	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	5'000	0	4'000	1'000 CHF	93.05%	930'500.00	0.02	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	9'400	0	0	9'400 CHF	91.73%	8'622'620.00	0.23	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	5'000	280	0	5'280 CHF	91.20%	4'815'360.00	0.13	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	10'000	5'480	200	15'280 CHF	95.07%	14'526'696.00	0.39	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	2'500	0	0	2'500 CHF	89.20%	2'230'000.00	0.06	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	7'500	0	0	7'500 CHF	90.85%	6'813'750.00	0.18	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	4'000	0	0	4'000 CHF	92.65%	3'706'000.00	0.10	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	460	460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	13'100	0	13'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	4'500	0	0	4'500 CHF	87.10%	3'919'500.00	0.10	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'875	0	0	1'875 CHF	96.40%	1'807'500.00	0.05	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	88.30%	3'532'000.00	0.09	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	15'000	0	0	15'000 CHF	89.90%	13'485'000.00	0.36	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	3'400	0	0	3'400 CHF	87.10%	2'961'400.00	0.08	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	89.45%	894'500.00	0.02	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	94.50%	8'883'000.00	0.24	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	3'000	0	1'000	2'000 CHF	79.25%	1'585'000.00	0.04	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	5'000	0	0	5'000 CHF	84.95%	4'247'500.00	0.11	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'500	0	0	1'500 CHF	91.25%	1'368'750.00	0.04	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	3'300	0	0	3'300 CHF	90.45%	2'984'850.00	0.08	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	3'200	0	0	3'200 CHF	83.90%	2'684'800.00	0.07	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	4'270	0	0	4'270 CHF	97.37%	4'157'699.00	0.11	a)
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	3'500	0	0	3'500 CHF	89.15%	3'120'250.00	0.08	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	20'000	0	0	20'000 CHF	91.00%	18'200'000.00	0.49	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	1'000	0	0	1'000 CHF	86.95%	869'500.00	0.02	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	11'000	0	0	11'000 CHF	89.25%	9'817'500.00	0.26	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	9'400	0	0	9'400 CHF	86.97%	8'175'180.00	0.22	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	2'800	0	0	2'800 CHF	91.50%	2'562'000.00	0.07	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	9'150	0	0	9'150 CHF	97.84%	8'952'360.00	0.24	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	0	5'000	3'000	2'000 CHF	94.70%	1'894'000.00	0.05	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.
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	10'000	0	0	10'000 CHF	87.85%	8'785'000.00	0.23	a)
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	8'000	0	0	8'000 CHF	92.85%	7'428'000.00	0.20	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	26'500	0	0	26'500 CHF	91.47%	24'239'550.00	0.65	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	6'400	0	0	6'400 CHF	94.60%	6'054'400.00	0.16	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	17'500	0	1'000	16'500 CHF	91.43%	15'085'950.00	0.40	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	10'000	0	0	10'000 CHF	91.62%	9'162'000.00	0.24	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	5'600	0	0	5'600 CHF	96.92%	5'427'520.00	0.14	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	0	1'000	0	1'000 CHF	90.85%	908'500.00	0.02	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'000	0	0	2'000 CHF	97.31%	1'946'200.00	0.05	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	2'000	0	0	2'000 CHF	93.55%	1'871'000.00	0.05	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	5'000	0	0	5'000 CHF	97.75%	4'887'500.00	0.13	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	5'000	0	1'500	3'500 CHF	94.55%	3'309'250.00	0.09	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'000	0	0	6'000 CHF	82.40%	4'944'000.00	0.13	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	10'000	0	0	10'000 CHF	95.65%	9'565'000.00	0.26	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	4'500	0	0	4'500 CHF	96.36%	4'336'200.00	0.12	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	14'500	0	0	14'500 CHF	95.50%	13'847'500.00	0.37	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	3'700	0	0	3'700 CHF	94.35%	3'490'950.00	0.09	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	2'200	0	0	2'200 CHF	100.05%	2'201'100.00	0.06	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	12'000	0	0	12'000 CHF	99.19%	11'902'800.00	0.32	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	5'000	0	0	5'000 CHF	99.95%	4'997'500.00	0.13	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	4'500	0	0	4'500 CHF	97.75%	4'398'750.00	0.12	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	23'000	0	0	23'000 CHF	94.10%	21'643'000.00	0.58	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	3'000	0	0	3'000 CHF	98.95%	2'968'500.00	0.08	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	1'400	0	0	1'400 CHF	99.85%	1'397'900.00	0.04	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	16'250	0	0	16'250 CHF	99.79%	16'215'875.00	0.43	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	3'300	0	0	3'300 CHF	102.29%	3'375'570.00	0.09	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	14'250	0	0	14'250 CHF	99.30%	14'150'250.00	0.38	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	19'000	1'000	0	20'000 CHF	100.83%	20'166'000.00	0.54	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	15'000	0	5'000	10'000 CHF	102.43%	10'243'000.00	0.27	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	15'700	0	7'500	8'200 CHF	107.25%	8'794'500.00	0.23	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	18'800	0	0	18'800 CHF	100.61%	18'914'680.00	0.50	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	4'400	5'600	0	10'000 CHF	102.00%	10'200'000.00	0.27	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	10'500	0	0	10'500 CHF	104.15%	10'935'750.00	0.29	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	8'500	0	2'500	6'000 CHF	100.60%	6'036'000.00	0.16	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	10'000	19'000	0	29'000 CHF	100.70%	29'203'000.00	0.78	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	0	0	2'500 CHF	105.65%	2'641'250.00	0.07	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	6'000	0	0	6'000 CHF	101.80%	6'108'000.00	0.16	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	101.70%	5'085'000.00	0.14	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	6'000	0	0	6'000 CHF	105.69%	6'341'400.00	0.17	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	13'000	2'500	550	14'950 CHF	111.15%	16'616'925.00	0.44	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	12'000	0	0	12'000 CHF	121.00%	14'520'000.00	0.39	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	100.65%	10'065'000.00	0.27	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	110.50%	2'762'500.00	0.07	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	3'950	0	0	3'950 CHF	114.30%	4'514'850.00	0.12	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	3'300	0	0	3'300 CHF	105.28%	3'474'240.00	0.09	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	0	6'500	0	6'500 CHF	99.78%	6'485'700.00	0.17	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	0	10'000 CHF	100.81%	10'081'000.00	0.27	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	21'000	1'000	10'000	12'000 CHF	104.70%	12'564'000.00	0.34	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	4'000	0	0	4'000 CHF	111.13%	4'445'200.00	0.12	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	13'000	0	0	13'000 CHF	114.40%	14'872'000.00	0.40	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	9'600	0	9'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	21'000	0	4'000	17'000 CHF	101.65%	17'280'500.00	0.46	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	5'000	0	0	5'000 CHF	102.15%	5'107'500.00	0.14	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	5'500	0	0	5'500 CHF	104.20%	5'731'000.00	0.15	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	6'000	3'000	3'000	6'000 CHF	105.35%	6'321'000.00	0.17	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	5'500	0	0	5'500 CHF	100.95%	5'552'250.00	0.15	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	3'000	1'000	0	4'000 CHF	102.25%	4'090'000.00	0.11	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	116.95%	5'847'500.00	0.16	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	6'500	0	0	6'500 CHF	102.35%	6'652'750.00	0.18	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	2'000	0	0	2'000 CHF	104.55%	2'091'000.00	0.06	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.
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	1'000	0	0	1'000 CHF	105.57%	1'055'700.00	0.03	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	14'500	0	2'500	12'000 CHF	109.81%	13'177'200.00	0.35	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	0	2'300	0	2'300 CHF	108.30%	2'490'900.00	0.07	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	4'500	0	0	4'500 CHF	100.52%	4'523'400.00	0.12	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	10'000	0	0	10'000 CHF	102.08%	10'208'000.00	0.27	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	9'000	0	0	9'000 CHF	103.66%	9'329'400.00	0.25	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	5'000	0	0	5'000 CHF	103.70%	5'185'000.00	0.14	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	10'000	0	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.27	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	10'000	0	0	10'000 CHF	103.65%	10'365'000.00	0.28	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	9'500	0	0	9'500 CHF	114.65%	10'891'750.00	0.29	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	8'000	0	0	8'000 CHF	108.84%	8'707'200.00	0.23	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	8'000	0	0	8'000 CHF	122.75%	9'820'000.00	0.26	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	1'750	0	0	1'750 CHF	104.75%	1'833'125.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	10'000	0	0	10'000 CHF	103.05%	10'305'000.00	0.27	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	4'700	0	0	4'700 CHF	103.54%	4'866'380.00	0.13	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	5'450	0	0	5'450 CHF	106.95%	5'828'775.00	0.16	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	14'200	3'100	0	17'300 CHF	104.25%	18'035'250.00	0.48	a)
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	10'000	0	0	10'000 CHF	102.25%	10'225'000.00	0.27	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	0	12'500	0	12'500 CHF	101.94%	12'742'500.00	0.34	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	4'000	5'000	0	9'000 CHF	103.75%	9'337'500.00	0.25	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	4'000	0	0	4'000 CHF	102.95%	4'118'000.00	0.11	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	3'500	0	0	3'500 CHF	106.75%	3'736'250.00	0.10	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	0	4'000	2'000	2'000 CHF	102.80%	2'056'000.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	37'500	0	1'000	36'500 CHF	103.18%	37'660'700.00	1.00	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	10'495	0	0	10'495 CHF	105.55%	10'552'722.50	0.28	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	2'000	0	1'000	1'000 CHF	101.71%	1'017'100.00	0.03	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	31'700	0	0	31'700 CHF	107.20%	33'982'400.00	0.91	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	10'000	0	0	10'000 CHF	100.95%	10'095'000.00	0.27	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	5'140	1'735	0	6'875 CHF	103.45%	7'112'187.50	0.19	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	10'000	0	0	10'000 CHF	100.21%	10'021'000.00	0.27	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	5'000	5'000	0	10'000 CHF	106.55%	10'655'000.00	0.28	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	30'500	0	0	30'500 CHF	106.95%	32'619'750.00	0.87	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	2'000	0	0	2'000 CHF	103.85%	2'077'000.00	0.06	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	2'500	0	2'500 CHF	103.60%	2'590'000.00	0.07	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	4'650	215	0	4'865 CHF	136.45%	6'638'292.50	0.18	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	10'000	0	0	10'000 CHF	101.20%	10'120'000.00	0.27	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	6'185	1'250	4'935 CHF	104.45%	5'154'607.50	0.14	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	10'000	0	2'000	8'000 CHF	103.20%	8'256'000.00	0.22	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	27'250	0	0	27'250 CHF	105.65%	28'789'625.00	0.77	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	1'000	0	0	1'000 CHF	103.85%	1'038'500.00	0.03	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	3'300	0	1'300	2'000 CHF	105.80%	2'116'000.00	0.06	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	9'450	0	2'500	6'950 CHF	108.45%	7'537'275.00	0.20	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	4'000	0	0	4'000 CHF	110.53%	4'421'200.00	0.12	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	9'700	0	0	9'700 CHF	103.90%	10'078'300.00	0.27	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	11'250	0	4'000	7'250 CHF	106.85%	7'746'625.00	0.21	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	22'500	2'500	0	25'000 CHF	106.39%	26'597'500.00	0.71	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	0	5'000	0	5'000 CHF	103.70%	5'185'000.00	0.14	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	5'000	0	0	5'000 CHF	102.75%	5'137'500.00	0.14	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	5'000	0	0	5'000 CHF	103.10%	5'155'000.00	0.14	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	6'990	0	6'990 CHF	103.20%	7'213'680.00	0.19	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	6'000	0	1'500	4'500 CHF	107.20%	4'824'000.00	0.13	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'500	0	2'500 CHF	105.75%	2'643'750.00	0.07	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	5'000	0	0	5'000 CHF	106.45%	5'322'500.00	0.14	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	600	0	600 CHF	104.40%	626'400.00	0.02	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	6'800	0	6'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	3'850	0	0	3'850 CHF	104.15%	4'009'775.00	0.11	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	10'000	0	0	10'000 CHF	101.40%	10'140'000.00	0.27	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	5'000	0	0	5'000 CHF	103.80%	5'190'000.00	0.14	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	5'000	0	0	5'000 CHF	102.55%	5'127'500.00	0.14	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.
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	5'000	0	0	5'000 CHF	104.35%	5'217'500.00	0.14	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	2'700	6'530	0	9'230 CHF	104.90%	9'682'270.00	0.26	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	5'000	0	1'200	3'800 CHF	100.70%	3'826'600.00	0.10	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	5'000	4'000	0	9'000 CHF	104.15%	9'373'500.00	0.25	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	16'000	0	0	16'000 CHF	105.55%	16'888'000.00	0.45	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	5'000	0	5'000 CHF	102.10%	5'105'000.00	0.14	a)
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	0	8'000	0	8'000 CHF	104.15%	8'332'000.00	0.22	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	3'750	0	3'750 CHF	105.55%	3'958'125.00	0.11	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	4'000	0	4'000 CHF	105.55%	4'222'000.00	0.11	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	5'800	0	5'800 CHF	102.35%	5'936'300.00	0.16	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	3'500	0	3'500 CHF	100.55%	3'519'250.00	0.09	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	3'000	0	3'000 CHF	99.87%	2'996'100.00	0.08	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	32'500	0	32'500 CHF	100.02%	32'506'500.00	0.87	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	0	4'000	0	4'000 CHF	100.25%	4'010'000.00	0.11	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	5'000	0	5'000 CHF	100.05%	5'002'500.00	0.13	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	9'335	3'500	5'835 CHF	100.35%	5'855'422.50	0.16	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	2'500	0	2'500 CHF	103.70%	2'592'500.00	0.07	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLLI 2 1/4 12/05/25	0	5'500	3'000	2'500 CHF	101.00%	2'525'000.00	0.07	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLLI 2 3/8 12/05/29	0	5'000	0	5'000 CHF	103.30%	5'165'000.00	0.14	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	15'500	15'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346304	1.2500 % ZURCTY 1 1/4 03/25/33	0	5'000	0	5'000 CHF	100.12%	5'006'100.00	0.13	a)
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	5'000	0	5'000 CHF	101.62%	5'081'000.00	0.14	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	9'220	0	9'220 CHF	101.75%	9'381'350.00	0.25	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	7'100	0	7'100 CHF	101.90%	7'234'900.00	0.19	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	7'500	0	7'500 CHF	100.25%	7'518'750.00	0.20	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	5'000	0	5'000 CHF	100.46%	5'023'000.00	0.13	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	101.50%	2'030'000.00	0.05	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	3'000	0	3'000 CHF	102.35%	3'070'500.00	0.08	a)
CH1319968579	2.1000 % ALLNSW 2.1 04/04/31	0	2'500	0	2'500 CHF	101.25%	2'531'250.00	0.07	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	5'000	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.14	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	4'100	0	4'100 CHF	100.65%	4'126'650.00	0.11	a)
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968694	1.4500 % PFZENT 1.45 09/07/39 593	0	15'000	0	15'000 CHF	100.10%	15'014'850.00	0.40	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	1'200	0	1'200 CHF	100.00%	1'200'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	5'000	0	5'000 CHF	100.35%	5'017'500.00	0.13	a)
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	10'000	0	10'000 CHF	102.60%	10'260'000.00	0.27	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	5'100	5'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	4'500	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH							2'559'671'798.50	68.30	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	99.46%	2'983'800.00	0.08	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	97.56%	3'902'400.00	0.10	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	95.60%	8'604'000.00	0.23	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	7'200	0	0	7'200 CHF	96.00%	6'912'000.00	0.18	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	10'000	0	4'000	6'000 CHF	96.15%	5'769'000.00	0.15	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	101.25%	6'075'000.00	0.16	a)
CL							34'246'200.00	0.91	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	0	800	0	800 CHF	101.67%	813'360.00	0.02	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	7'000	1'500	8'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	94.55%	2'363'750.00	0.06	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	520	0	520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	91.30%	913'000.00	0.02	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	99.31%	2'582'060.00	0.07	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	3'000	460	0	3'460 CHF	89.95%	3'112'270.00	0.08	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	5'000	2'000	0	7'000 CHF	93.85%	6'569'500.00	0.18	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.
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	93.60%	3'744'000.00	0.10	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	85.55%	2'566'500.00	0.07	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	95.40%	3'434'400.00	0.09	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	3'500	0	2'000	1'500 CHF	90.00%	1'350'000.00	0.04	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	7'800	0	0	7'800 CHF	95.40%	7'441'200.00	0.20	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	8'000	0	7'000	1'000 CHF	91.95%	919'500.00	0.02	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	7'000	0	6'000	1'000 CHF	92.20%	922'000.00	0.02	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	97.55%	7'413'800.00	0.20	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	5'000	6'000	0	11'000 CHF	104.50%	11'495'000.00	0.31	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	112.65%	10'138'500.00	0.27	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.60%	5'180'000.00	0.14	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTM	0	2'000	0	2'000 CHF	102.80%	2'056'000.00	0.05	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	10'500	0	1'000	9'500 CHF	100.80%	9'576'000.00	0.26	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	10'000	0	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 CHF	103.60%	3'108'000.00	0.08	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	105.25%	8'420'000.00	0.22	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	104.55%	4'182'000.00	0.11	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.03	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.50%	5'075'000.00	0.14	a)
DE							104'392'340.00	2.79	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.35%	10'235'000.00	0.27	a)
DK							10'235'000.00	0.27	
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	100.21%	4'008'400.00	0.11	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	99.63%	3'586'680.00	0.10	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	1'400	0	0	1'400 CHF	96.40%	1'349'600.00	0.04	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	6'300	0	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	96.10%	2'498'600.00	0.07	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	101.15%	12'138'000.00	0.32	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	10'500	0	0	10'500 CHF	101.25%	10'631'250.00	0.28	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	7'500	3'000	0	10'500 CHF	104.75%	10'998'750.00	0.29	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	5'200	0	5'200 CHF	102.15%	5'311'800.00	0.14	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	103.05%	8'244'000.00	0.22	a)
ES							58'767'080.00	1.57	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	700	0	0	700 CHF	99.73%	698'110.00	0.02	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	97.20%	1'166'400.00	0.03	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.60%	10'160'000.00	0.27	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	11'000	0	200	10'800 CHF	102.95%	11'118'600.00	0.30	a)
FI							23'143'110.00	0.62	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	10'000	0	3'000	7'000 CHF	100.98%	7'068'600.00	0.19	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	4'320	0	0	4'320 CHF	101.85%	4'399'920.00	0.12	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	96.40%	5'784'000.00	0.15	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	97.00%	7'760'000.00	0.21	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	2'000	4'600	0	6'600 CHF	99.27%	6'551'820.00	0.17	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	4'600	0	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 CHF	93.90%	2'817'000.00	0.08	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	93.75%	3'750'000.00	0.10	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	95.70%	2'488'200.00	0.07	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	93.65%	4'682'500.00	0.12	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	93.85%	1'313'900.00	0.04	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	93.00%	7'440'000.00	0.20	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	92.80%	1'856'000.00	0.05	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 CHF	95.30%	3'812'000.00	0.10	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	13'000	0	0	13'000 CHF	95.25%	12'382'500.00	0.33	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.
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	104.60%	3'556'400.00	0.09	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	7'800	0	0	7'800 CHF	94.15%	7'343'700.00	0.20	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	102.65%	1'231'800.00	0.03	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.45%	5'222'500.00	0.14	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.05%	2'021'000.00	0.05	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	104.45%	3'133'500.00	0.08	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	102.00%	2'550'000.00	0.07	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	10'000	6'000	0	16'000 CHF	104.70%	16'752'000.00	0.45	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.70%	5'235'000.00	0.14	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	104.80%	8'384'000.00	0.22	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	10'750	0	0	10'750 CHF	102.35%	11'002'625.00	0.29	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.15%	10'215'000.00	0.27	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	102.00%	2'652'000.00	0.07	a)
CH1290871024	1.5125 % RATFPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.10%	3'033'000.00	0.08	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.95%	10'295'000.00	0.27	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	104.75%	10'475'000.00	0.28	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.80%	5'040'000.00	0.13	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	8'000	3'000	5'000 CHF	103.05%	5'152'500.00	0.14	a)
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	101.60%	10'160'000.00	0.27	a)
CH1331113527	2.2875 % BPCEGP 2.2875 03/15/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.14%	2'022'720.00	0.05	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.97%	3'029'040.00	0.08	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	2'600	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
FR							200'613'225.00	5.35	
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	2'000	5'865	0	7'865 CHF	99.31%	7'810'731.50	0.21	a)
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	7'600	0	0	7'600 CHF	95.75%	7'277'000.00	0.19	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	14'000	0	0	14'000 CHF	95.55%	13'377'000.00	0.36	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	6'400	0	0	6'400 CHF	92.15%	5'897'600.00	0.16	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	6'400	0	0	6'400 CHF	94.05%	6'019'200.00	0.16	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	5'000	0	0	5'000 CHF	100.50%	5'025'000.00	0.13	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	104.15%	12'498'000.00	0.33	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.45%	5'072'500.00	0.14	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	5'000	0	1'200	3'800 CHF	101.40%	3'853'200.00	0.10	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	5'000	1'200	0	6'200 CHF	102.95%	6'382'900.00	0.17	a)
GB							73'213'131.50	1.95	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	10'000	2'000	0	12'000 CHF	99.40%	11'928'000.00	0.32	a)
IE							11'928'000.00	0.32	
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	14'000	0	0	14'000 CHF	99.17%	13'883'800.00	0.37	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	98.15%	11'778'000.00	0.31	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	10'000	0	0	10'000 CHF	100.89%	10'089'000.00	0.27	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	10'000	0	0	10'000 CHF	100.45%	10'045'000.00	0.27	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	4'545	0	0	4'545 CHF	100.80%	4'581'360.00	0.12	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	10'000	0	0	10'000 CHF	102.25%	10'225'000.00	0.27	a)
KR							60'602'160.00	1.62	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	500	4'200	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	8'000	0	8'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LU							0.00	0.00	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	3'000	0	0	3'000 CHF	103.85%	3'115'500.00	0.08	a)
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	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.
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	0	280	0	280 CHF	90.90%	254'520.00	0.01	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	4'480	0	0	4'480 CHF	80.30%	3'597'440.00	0.10	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	2'500	0	0	2'500 CHF	95.80%	2'395'000.00	0.06	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.10%	921'000.00	0.02	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	1'500	0	0	1'500 CHF	99.50%	1'492'500.00	0.04	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	98.80%	3'161'600.00	0.08	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	10'000	0	2'000	8'000 CHF	102.40%	8'192'000.00	0.22	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.55%	10'255'000.00	0.27	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	10'000	0	0	10'000 CHF	103.15%	10'315'000.00	0.28	a)
NL							43'699'560.00	1.17	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	93.15%	558'900.00	0.01	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	98.80%	2'618'200.00	0.07	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	99.80%	3'992'000.00	0.11	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	100.05%	5'002'500.00	0.13	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	102.20%	2'248'400.00	0.06	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.95%	10'295'000.00	0.27	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.20%	5'110'000.00	0.14	a)
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	99.49%	9'948'500.00	0.27	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.00%	5'000'000.00	0.13	a)
NO							44'773'500.00	1.19	
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	98.34%	7'867'200.00	0.21	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	3'750	0	0	3'750 CHF	99.44%	3'729'000.00	0.10	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'750	0	200	1'550 CHF	94.05%	1'457'775.00	0.04	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.10%	5'055'000.00	0.13	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	104.40%	5'220'000.00	0.14	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	3'750	0	250	3'500 CHF	103.95%	3'638'250.00	0.10	a)
NZ							26'967'225.00	0.72	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.03	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	5'910	0	0	5'910 CHF	94.25%	5'570'175.00	0.15	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	550	0	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	97.60%	3'904'000.00	0.10	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.70%	10'170'000.00	0.27	a)
SE							20'625'675.00	0.55	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	10'000	0	0	10'000 CHF	100.05%	10'005'000.00	0.27	a)
SG							10'005'000.00	0.27	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	2'250	0	0	2'250 CHF	99.45%	2'237'625.00	0.06	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	98.60%	4'930'000.00	0.13	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	13'910	0	0	13'910 CHF	97.60%	13'576'160.00	0.36	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'500	3'000	0	4'500 CHF	95.65%	4'304'250.00	0.11	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	95.00%	7'600'000.00	0.20	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	4'500	0	3'000	1'500 CHF	93.70%	1'405'500.00	0.04	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	92.75%	2'782'500.00	0.07	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	93.55%	7'016'250.00	0.19	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	3'000	0	0	3'000 CHF	103.55%	3'106'500.00	0.08	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	100.35%	10'035'000.00	0.27	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	10'000	0	10'000 CHF	102.65%	10'265'000.00	0.27	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	8'000	0	8'000 CHF	100.61%	8'048'880.00	0.21	a)
US							75'307'665.00	2.01	
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	4'000	0	0	4'000 CHF	109.00%	4'360'000.00	0.12	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	6'450	0	0	6'450 CHF	103.45%	6'672'525.00	0.18	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.
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	4'000	0	0	4'000 CHF	105.05%	4'202'000.00	0.11	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	98.40%	2'952'000.00	0.08	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	1'500	270	1'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	4'850	0	4'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	5'000	0	500	4'500 CHF	98.73%	4'442'850.00	0.12	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	8'250	4'900	0	13'150 CHF	87.10%	11'453'650.00	0.31	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.60%	1'852'000.00	0.05	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	90.35%	6'324'500.00	0.17	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.45%	2'893'500.00	0.08	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	10'000	0	5'000	5'000 CHF	99.05%	4'952'500.00	0.13	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.00%	5'050'000.00	0.13	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	9'650	0	0	9'650 CHF	101.00%	9'746'500.00	0.26	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	5'000	0	0	5'000 CHF	101.35%	5'067'500.00	0.14	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.35%	5'117'500.00	0.14	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	5'000	0	3'000	2'000 CHF	102.50%	2'050'000.00	0.05	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	10'000	5'000	0	15'000 CHF	101.60%	15'240'000.00	0.41	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	15'000	3'000	0	18'000 CHF	102.80%	18'504'000.00	0.49	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	2'500	0	2'500 CHF	100.08%	2'501'950.00	0.07	a)
XS							113'382'975.00	3.03	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Swaps

0.00 0.00

08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	-15'000	15'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	-30'000	30'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	30'000	0	30'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'715'496'045.00	99.14
Sonstige Vermögenswerte	32'406'168.58	0.86
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'747'902'213.58	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-19'452'405.65	
Andere Verbindlichkeiten	-837'620.85	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'727'612'187.08	

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);	3'715'496'045.00	99.14
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

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
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	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
AA CHF	0.850	1.300	0.650	0.200	2.000
BA CHF	0.530	1.000	0.330	0.200	2.000
CT CHF	0.490	0.850	0.290	0.200	2.000
DT CHF	0.400	0.750	0.300	0.100	2.000
GT CHF	0.380	0.650	0.280	0.100	2.000
NT CHF	-	-	-	-	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

Swiss Bond Index (SBI)® AAA-BBB Total Return

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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

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 Prüfgesellschaft 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 Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.