

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. WORLD

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	130002835	CHF
DTH1 CHF	11705252	CHF
GTH1 CHF	33096813	CHF
MTH1 CHF	51786288	CHF
NT CHF	130002836	CHF
NTH1 CHF	11705251	CHF
XT CHF	130002837	CHF
XTH1 CHF	30978876	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	32
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	32
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	32
7	Pauschale Verwaltungskommission	33
8	Benchmark	33
9	TER	33
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	34
11	Fussnoten	34
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	35
13	Pflichtpublikationen	37

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	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		870'235'150.76	631'529'677.30	818'189'608.63	1'206'293'399.26
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'959'698.49			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'752.322			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.6333			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		125.6412			
Thesaurierung je Anteil		3.30			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %			
Klasse DTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		12'542'276.07	12'858'911.73	23'518'547.76	18'744'598.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		126'551.012	130'700.245	207'823.120	156'479.806
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.1085	98.3848	113.1662	119.7893
Thesaurierung je Anteil		2.91	3.01	3.28	3.10
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.22 %	0.22 %	0.23 %	0.26 %
Klasse GTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'329'315.02	5'922'632.90	6'831'965.97	11'126'490.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		84'491.468	68'786.464	68'995.269	106'172.056
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		86.7462	86.1017	99.0208	104.7968
Thesaurierung je Anteil		2.57	2.66	2.90	2.75
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.19 %	0.19 %	0.20 %	0.22 %
Klasse MTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'657'612.10	1'643'232.01	1'887'710.17	10'212.52
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		19'538.785	19'538.785	19'538.785	100.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.8370	84.1010	96.6135	102.1252
Thesaurierung je Anteil		2.67	2.76	3.03	2.90
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		114'195'873.88			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'009'848.843			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		113.0821			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		128.4222			
Thesaurierung je Anteil		3.59			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %			
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		729'690'117.49	610'512'457.17	785'269'476.56	1'165'872'923.59
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'184'509.675	6'063'667.725	6'789'325.907	9'535'984.709
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.5644	100.6837	115.6624	122.2604
Thesaurierung je Anteil		3.20	3.30	3.63	3.47
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Klasse XT CHF					
CHF					
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'263'901.15			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'802.947			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		91.5675			
Thesaurierung je Anteil		2.63			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %			
Klasse XTH1 CHF					
CHF					
Nettofondvermögen am Ende der Rechnungsperiode		596'356.56	592'443.49	681'908.17	10'539'174.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'682.401	6'682.401	6'682.401	97'494.368
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.2429	88.6573	102.0454	108.1003
Thesaurierung je Anteil		2.52	2.61	2.85	2.70
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.33 %	0.33 %	0.34 %	0.35 %

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 (Lancierung 08.02.2024)	0.66 %	-	-	-
Klasse DTH1 CHF	1.82 %	4.14 %	-16.72 %	-2.29 %
Klasse GTH1 CHF	1.84 %	4.16 %	-16.69 %	-2.25 %
Klasse MTH1 CHF	2.04 %	4.36 %	-16.54 %	-2.06 %
Klasse NT CHF (Lancierung 08.02.2024)	0.67 %	-	-	-
Klasse NTH1 CHF	2.04 %	4.36 %	-16.54 %	-2.06 %
Klasse XT CHF (Lancierung 08.02.2024)	0.65 %	-	-	-
Klasse XTH1 CHF	1.70 %	4.02 %	-16.81 %	-2.39 %
Benchmark Hedge	-7.40 %	4.54 %	-16.86 %	-
Benchmark	0.67 %	-	-	-2.00 %
Tracking Error 33)	0.17 %	0.17 %	0.22 %	0.07 %

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 (Lancierung 08.02.2024)	8.06 %
Klasse DTH1 CHF	9.22 %
Klasse GTH1 CHF	9.24 %
Klasse MTH1 CHF	9.44 %
Klasse NT CHF (Lancierung 08.02.2024)	8.07 %
Klasse NTH1 CHF	9.44 %
Klasse XT CHF (Lancierung 08.02.2024)	8.05 %
Klasse XTH1 CHF	9.10 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	3'438'731.16	3'236'311.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	125'299'224.26	110'073'375.77
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	753'683'121.40	519'254'360.84
Derivative Finanzinstrumente	7'243.02	-4'464'045.57
Sonstige Vermögenswerte	3'326'243.15	3'432'904.98
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	885'754'562.99	631'532'907.02
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-15'515'462.98	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-3'949.25	-3'229.72
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	870'235'150.76	631'529'677.30

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von	Lancierung 08.02.2024	
Klasse DT CHF	bis	29.02.2024	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		26'752.322	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'752.322	
	von	01.03.2023	01.03.2022
Klasse DTH1 CHF	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		130'700.245	207'823.120
Ausgegebene Anteile		7'162.551	35'144.076
Zurückgenommene Anteile		-11'311.784	-112'266.951
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		126'551.012	130'700.245
	von	01.03.2023	01.03.2022
Klasse GTH1 CHF	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		68'786.464	68'995.269
Ausgegebene Anteile		25'102.969	3'781.333
Zurückgenommene Anteile		-9'397.965	-3'990.138
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		84'491.468	68'786.464
	von	01.03.2023	01.03.2022
Klasse MTH1 CHF	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		19'538.785	19'538.785
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		19'538.785	19'538.785
	von	Lancierung 08.02.2024	
Klasse NT CHF	bis	29.02.2024	
Ausgegebene Anteile		389.369	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		1'009'460.872	
Zurückgenommene Anteile		-1.398	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'009'848.843	
	von	01.03.2023	01.03.2022
Klasse NTH1 CHF	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		6'063'667.725	6'789'325.907
Ausgegebene Anteile		1'390'310.913	1'361'232.213
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		288'490.764	104'065.686
Zurückgenommene Anteile		-477'459.727	-664'989.610
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-80'500.000	-1'525'966.471
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'184'509.675	6'063'667.725
	von	Lancierung 08.02.2024	
Klasse XT CHF	bis	29.02.2024	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		13'802.947	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'802.947	
	von	01.03.2023	01.03.2022
Klasse XTH1 CHF	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		6'682.401	6'682.401
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		6'682.401	6'682.401

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	15.05.2023	8'957'408.84	87'847.533
Klasse NTH1 CHF	23.05.2023	8'981'114.52	88'964.911
Klasse NTH1 CHF	30.08.2023	11'123'104.83	111'678.320

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	2'353'288.70	23'000.000
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	5'115'845.00	50'000.000
Klasse NTH1 CHF	31.03.2023	767'376.75	7'500.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		631'529'677.30	818'189'608.63
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-7'605'001.58	-9'736'079.69
Saldo aus dem Anteilverkehr		224'868'434.74	-72'151'332.66
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		21'442'040.30	-104'772'518.98
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		870'235'150.76	631'529'677.30

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		31'981.71	3'221.83
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-8'843.67
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'635'052.04	3'861'836.28
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		17'556'806.20	21'308'156.93
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		3'709'004.90	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'750'623.52	2'437'548.36
Total Ertrag		28'683'468.37	27'601'919.73
Aufwand			
Passivzinsen		-178.75	-268.30
Reglementarische Vergütungen		-42'131.07	-57'304.03
Sonstige Aufwendungen		-2.25	-107.30
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'245'305.75	-6'847'906.76
Total Aufwand		-1'287'617.82	-6'905'586.39
Nettoertrag / Verlust		27'395'850.55	20'696'333.34
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-32'360'370.38	-55'646'475.86
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		717'868.89	682'016.53
Realisierter Erfolg		-4'246'650.94	-34'268'125.99
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		25'688'691.24	-70'504'392.99
Gesamterfolg		21'442'040.30	-104'772'518.98

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	88'284.88	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	88'284.88	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	30'899.71	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	57'385.17	
Total	88'284.88	
Klasse DTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	368'380.57	393'497.87
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	368'380.57	393'497.87
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	128'933.20	137'724.25
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	239'447.37	255'773.62
Total	368'380.57	393'497.87
Klasse GTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	217'419.03	183'047.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	217'419.03	183'047.86
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	76'096.66	64'066.75
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	141'322.37	118'981.11
Total	217'419.03	183'047.86
Klasse MTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	52'226.94	53'961.40
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	52'226.94	53'961.40
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	18'279.43	18'886.49
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	33'947.51	35'074.91
Total	52'226.94	53'961.40
Klasse NT CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	3'625'531.72	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'625'531.72	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'268'936.10	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'356'595.62	
Total	3'625'531.72	
Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	22'990'763.82	20'048'360.43
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	22'990'763.82	20'048'360.43
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	8'046'767.34	7'016'926.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	14'943'996.48	13'031'434.28
Total	22'990'763.82	20'048'360.43
Klasse XT CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	36'365.19	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	36'365.19	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'727.82	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	23'637.37	
Total	36'365.19	
Klasse XTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	16'878.40	17'465.78
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	16'878.40	17'465.78
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'907.44	6'113.02
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'970.96	11'352.76
Total	16'878.40	17'465.78

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							125'299'224.26	14.15	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							125'299'224.26	14.15	
AT0000A2GH08	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/13/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.81%	87'484.22	0.01	a)
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.14%	88'746.79	0.01	a)
AT0000A2JAF6	0.0500 % ERSTBK 0.05 09/16/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.34%	89'895.97	0.01	a)
AT0000A2KW37	0.1000 % ERSTBK 0.1 11/16/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.58%	83'450.67	0.01	a)
AT0000A2QL75	1.0000 % VIGAV 1 03/26/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.60%	73'944.70	0.01	a)
AT0000A2RAA0	0.1250 % ERSTBK 0 1/8 05/17/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.93%	82'834.15	0.01	a)
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.10%	82'999.00	0.01	a)
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.27%	83'154.32	0.01	a)
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	0	100	0	100 EUR	101.61%	96'819.62	0.01	a)
AT0000A34QR4	4.2500 % ERSTBK 4 1/4 05/30/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.40%	97'570.49	0.01	a)
BE0002432079	3.2500 % ELIATB 3 1/4 04/04/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.22%	189'088.27	0.02	a)
BE0002595735	1.8750 % GBLBBB 1 7/8 06/19/25	200	0	0	200 EUR	97.65%	186'094.31	0.02	a)
BE6265142099	2.7000 % ABIBB 2.7 03/31/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.43%	187'575.09	0.02	a)
BE6276040431	1.5000 % ABIBB 1 1/2 04/18/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	89.82%	128'376.26	0.01	a)
BE6285455497	2.0000 % ABIBB 2 03/17/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.04%	181'124.07	0.02	a)
BE6285457519	2.7500 % ABIBB 2 3/4 03/17/36 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.50%	176'277.71	0.02	a)
BE6301510028	1.1500 % ABIBB 1.15 01/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.04%	89'604.39	0.01	a)
BE6312821612	1.1250 % ABIBB 1 1/8 07/01/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.12%	88'736.31	0.01	a)
BE6312822628	1.6500 % ABIBB 1.65 03/28/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.26%	85'049.61	0.01	a)
BE6320934266	2.1250 % ABIBB 2 1/8 12/02/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.96%	91'440.59	0.01	a)
BE6320935271	2.8750 % ABIBB 2 7/8 04/02/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.01%	91'485.38	0.01	a)
BE6320936287	3.7000 % ABIBB 3.7 04/02/40 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.42%	189'471.33	0.02	a)
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	100	0	0	100 EUR	80.00%	76'227.81	0.01	a)
BE6330288687	0.7500 % AEDBB 0 3/4 09/09/31	0	200	100	100 EUR	77.30%	73'659.79	0.01	a)
CH1224575899	5.2300 % RAIFFS 5.23 11/01/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.87%	98'971.23	0.01	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.02%	98'165.09	0.01	a)
DE000A19B8E2	1.7500 % ANNGR 1 3/4 01/25/27 EMTN	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1HG1K6	3.0000 % ALVGR 3 03/13/28 61	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2NBKK3	0.1250 % PBBGR 0 1/8 09/05/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2T5DE2	1.7500 % DT 1 3/4 03/25/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.80%	86'522.76	0.01	a)
DE000A30VGD9	2.6250 % HERAEU 2 5/8 06/09/27	0	200	100	100 EUR	95.68%	91'170.93	0.01	a)
DE000A3E5L98	0.2500 % EWE 0 1/4 06/08/28 EMTN	0	150	100	50 EUR	86.45%	41'187.43	0.00	a)
DE000A3H2TW4	0.3750 % EWE 0 3/8 10/22/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	75.68%	72'114.21	0.01	a)
DE000A3KNP88	0.1250 % TRAGR 0 1/8 03/24/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3KNP96	0.7500 % TRAGR 0 3/4 03/24/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JJO	0.1250 % BYLAN 0 1/8 02/10/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.61%	80'627.27	0.01	a)
DE000BLB6JU7	3.7500 % BYLAN 3 3/4 02/07/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.66%	93'060.50	0.01	a)
DE000GRN0024	0.0100 % DKRED 0.01 02/23/26	0	200	100	100 EUR	91.92%	87'587.13	0.01	a)
DE000HCB0AZ3	0.3750 % HCOB 0 3/8 03/09/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.12%	85'870.99	0.01	a)
DE000HCB0B56	4.8750 % HCOB 4 7/8 03/17/25 EMTN	0	232	132	100 EUR	98.46%	93'824.71	0.01	a)
DE000HCB0BZ1	4.8750 % HCOB 4 7/8 03/30/27 EMTN	0	100	50	50 EUR	99.21%	47'268.26	0.01	a)
DE000MHB64E1	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 03/09/29 EMTN	0	200	100	100 EUR	82.84%	78'932.09	0.01	a)
DE000NLB3UX1	0.0100 % NDB 0.01 09/23/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.12%	87'776.76	0.01	a)
DE000NLB4RS5	4.8750 % NDB 4 7/8 07/11/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.11%	99'202.78	0.01	a)
DE000TLX2102	2.5000 % TALANX 2 1/2 07/23/26	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030485271	0.1250 % ENXFP 0 1/8 05/17/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0030486592	1.5000 % ENXFP 1 1/2 05/17/41	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0205045026	0.8750 % CAIXAB 0 7/8 10/28/27 EMTN	0	200	100	100 EUR	89.96%	85'716.62	0.01	a)
ES0224244071	1.6250 % MAPSM 1 5/8 05/19/26	0	100	0	100 EUR	96.21%	91'678.78	0.01	a)
ES0224244089	4.3750 % MAPSM 4 3/8 03/31/47	0	100	0	100 EUR	99.16%	94'483.15	0.01	a)
FR0010800540	4.6250 % EDF 4 5/8 09/11/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0010961581	4.5000 % EDF 4 1/2 11/12/40 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011225143	4.1250 % EDF 4 1/8 03/25/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011439785	2.6250 % SAGESS 2 5/8 03/06/25	0	100	0	100 EUR	98.84%	94'182.99	0.01	a)
FR0011991488	2.7500 % RTEFRA 2 3/4 06/20/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012146801	1.7500 % SANFP 1 3/4 09/10/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.28%	91'745.52	0.01	a)
FR0012222297	4.5000 % ACAFP 4 1/2 PERP	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012300812	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/15/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012444750	4.2500 % ACAFP 4 1/4 PERP	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012949923	1.7500 % VIEFP 1 3/4 09/10/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012969038	1.5000 % SANFP 1 1/2 09/22/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.05%	92'479.24	0.01	a)
FR0012969129	1.5000 % SAGESS 1 1/2 10/25/27	0	100	0	100 EUR	93.91%	89'485.28	0.01	a)
FR0013060209	1.6250 % RTEFRA 1 5/8 11/27/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013144003	1.1250 % SANFP 1 1/8 04/05/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.98%	87'643.35	0.01	a)
FR0013152899	1.0000 % RTEFRA 1 10/19/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013152907	2.0000 % RTEFRA 2 04/18/36 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013155009	2.8750 % BPCEGP 2 7/8 04/22/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.68%	93'077.65	0.01	a)
FR0013182078	1.1250 % ARRF 1 1/8 01/09/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.68%	91'170.93	0.01	a)
FR0013201639	0.5000 % SANFP 0 1/2 01/13/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.74%	88'371.36	0.01	a)
FR0013203734	4.7500 % ACAFP 4 3/4 09/27/48	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013204468	1.0000 % BPCEGP 1 10/05/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.18%	84'975.28	0.01	a)
FR0013213295	1.0000 % EDF 1 10/13/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013214137	0.6250 % SAGESS 0 5/8 10/20/28	0	100	0	100 EUR	89.06%	84'866.65	0.01	a)
FR0013264421	1.5000 % CTEFRA 1 1/2 07/29/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013290749	1.8750 % RTEFRA 1 7/8 10/23/37 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013295722	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/17/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.51%	80'525.32	0.01	a)
FR0013311347	0.7500 % HOFF 0 3/4 01/23/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013312154	2.6250 % ACAFP 2 5/8 01/29/48	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013312501	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/31/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.30%	87'949.23	0.01	a)
FR0013324340	1.0000 % SANFP 1 03/21/26 8FXD	0	100	0	100 EUR	95.39%	90'899.36	0.01	a)
FR0013324357	1.3750 % SANFP 1 3/8 03/21/30 12FX	0	200	0	200 EUR	89.60%	170'756.70	0.02	a)
FR0013324373	1.8750 % SANFP 1 7/8 03/21/38 20FX	0	100	0	100 EUR	84.21%	80'241.36	0.01	a)
FR0013382348	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/25/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.84%	85'610.85	0.01	a)
FR0013409844	0.8750 % SANFP 0 7/8 03/21/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.67%	85'446.01	0.01	a)
FR0013412343	1.0000 % BPCEGP 1 04/01/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.93%	92'363.94	0.01	a)
FR0013421815	1.0000 % ACAFP 1 07/03/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013445152	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 09/09/49 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013455540	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 02/24/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.76%	86'482.74	0.01	a)
FR0013463650	0.1250 % EFFF 0 1/8 05/27/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.84%	182'639.16	0.02	a)
FR0013463668	0.3750 % EFFF 0 3/8 11/27/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.03%	171'576.18	0.02	a)
FR0013463676	0.7500 % EFFF 0 3/4 11/27/31	0	100	0	100 EUR	83.75%	79'805.89	0.01	a)
FR0013465424	2.0000 % EDF 2 12/09/49 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013476199	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/15/26	0	500	400	100 EUR	93.71%	89'293.75	0.01	a)
FR0013476207	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 01/15/30	0	100	0	100 EUR	84.46%	80'484.34	0.01	a)
FR0013505104	1.0000 % SANFP 1 04/01/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.26%	92'680.30	0.01	a)
FR0013505112	1.5000 % SANFP 1 1/2 04/01/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.85%	86'567.55	0.01	a)
FR0013509726	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 04/28/25	0	100	0	100 EUR	96.43%	91'890.36	0.01	a)
FR0013516069	0.3750 % EFFF 0 3/8 01/05/26 EMTN	0	200	100	100 EUR	94.46%	90'013.18	0.01	a)
FR0013516077	0.5000 % EFFF 0 1/2 06/05/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.58%	85'359.29	0.01	a)
FR0013522703	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 07/08/40 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013523602	2.0000 % ACAFP 2 07/17/30	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534278	0.1250 % ARRF 0 1/8 01/18/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.78%	81'740.24	0.01	a)
FR0013534674	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN	0	100	0	100 EUR	91.61%	87'294.60	0.01	a)
FR0014000Y93	0.1250 % ACAFP 0 1/8 12/09/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001G29	0.0100 % BPCEGP 0.01 01/14/27	0	100	0	100 EUR	90.26%	86'009.16	0.01	a)
FR0014001G37	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/14/31	0	100	0	100 EUR	79.47%	75'729.45	0.01	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.59%	77'746.71	0.01	a)
FR0014002G36	0.7500 % SAFFP 0 3/4 03/17/31	200	0	0	200 EUR	85.09%	162'154.07	0.02	a)
FR0014003182	0.3750 % ACAFP 0 3/8 04/20/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005J14	0.5000 % ACAFP 0 1/2 09/21/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SOL1	0.0000 % ARVASL 0 10/01/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.09%	179'307.88	0.02	a)
FR0014006IVO	0.0000 % ARRF 0 06/19/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.72%	82'632.14	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0014006UO0	1.0000 % EDF 1 11/29/33 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.60%	86'332.19	0.01 a)	
FR0014007LM1	1.0000 % BPCEGP 1 01/14/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	80.61%	76'809.07	0.01 a)	
FR0014007MK3	1.1250 % ACAFP 1 1/8 07/12/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007ML1	0.6250 % ACAFP 0 5/8 01/12/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007VF4	0.3750 % BPCEGP 0 3/8 02/02/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.91%	89'483.37	0.01 a)	
FR0014008FH1	0.8750 % ARVASL 0 7/8 02/17/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008MT2	1.1250 % ACAFP 1 1/8 02/24/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 03/02/29	0	100	0	100 EUR	91.26%	86'960.14	0.01 a)	
FR00140098S7	1.0000 % ACAFP 1 09/18/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009KQ0	1.2500 % SANFP 1 1/4 04/06/29	0	100	0	100 EUR	90.89%	86'609.48	0.01 a)	
FR0014009YD9	1.7500 % BPCEGP 1 3/4 04/26/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.57%	90'115.13	0.01 a)	
FR001400AOL7	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/03/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.40%	177'996.71	0.02 a)	
FR001400CKB2	2.8750 % SAGES 2 7/8 09/07/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.40%	91'857.96	0.01 a)	
FR001400CSG4	4.0000 % ARVASL 4 09/22/26 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400E3H8	4.7500 % ARVASL 4 3/4 05/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.51%	97'683.89	0.01 a)	
FR001400E797	4.0000 % BPCEGP 4 11/29/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.43%	97'599.08	0.01 a)	
FR001400E7I7	3.8750 % ACAFP 3 7/8 11/28/34 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F075	4.3750 % BPCEGP 4 3/8 07/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.52%	96'734.81	0.01 a)	
FR001400F083	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 01/13/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.24%	196'745.64	0.02 a)	
FR001400F6O6	4.1250 % ARVASL 4 1/8 04/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.24%	95'517.98	0.01 a)	
FR001400FB06	3.5000 % BPCEGP 3 1/2 01/25/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.46%	94'774.73	0.01 a)	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.00%	97'193.15	0.01 a)	
FR001400G6Y4	4.6250 % BPCEGP 4 5/8 03/02/30	0	100	0	100 EUR	102.66%	97'820.15	0.01 a)	
FR001400HAC0	3.6250 % BPCEGP 3 5/8 04/17/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.78%	95'076.80	0.01 a)	
XS0161488498	7.5000 % DT 7 1/2 01/24/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	129.17%	123'082.99	0.01 a)	
XS0162990229	5.6250 % EDF 5 5/8 02/21/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0229567440	4.1250 % GE 4 1/8 09/19/35 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0834385923	3.2500 % BHP 3 1/4 09/24/27 10	0	150	0	150 EUR	99.34%	141'993.44	0.02 a)	
XS0857662448	2.3750 % MCD 2 3/8 11/27/24 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0909359332	2.7500 % BATSLN 2 3/4 03/25/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.72%	94'064.84	0.01 a)	
XS0924998809	3.1250 % BHP 3 1/8 04/29/33 13	0	200	0	200 EUR	95.79%	182'553.40	0.02 a)	
XS0935427970	2.8750 % JPM 2 7/8 05/24/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0942082115	2.8750 % VGASDE 2 7/8 06/12/25 02	0	100	0	100 EUR	98.96%	94'295.43	0.01 a)	
XS0951216166	3.1250 % ORCL 3 1/8 07/10/25	170	0	0	170 EUR	98.85%	160'132.15	0.02 a)	
XS0970852348	3.7500 % ENIIM 3 3/4 09/12/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1023703090	3.6250 % ENIIM 3 5/8 01/29/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1028421383	3.1250 % ACAFP 3 1/8 02/05/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1030900242	3.2500 % VZ 3 1/4 02/17/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1040105980	2.8750 % PM 2 7/8 03/03/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.29%	234'142.50	0.03 a)	
XS1040508241	3.3750 % IMBLN 3 3/8 02/26/26 EMTN	300	0	200	100 EUR	99.08%	94'413.59	0.01 a)	
XS1043097630	3.1250 % BATSLN 3 1/8 03/06/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.37%	229'566.28	0.03 a)	
XS1048428442	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1066312395	2.8750 % PM 2 7/8 05/14/29	250	0	0	250 EUR	95.83%	228'277.51	0.03 a)	
XS1069521083	2.3750 % ACAFP 2 3/8 05/20/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1072516690	3.0000 % PLD 3 06/02/26	0	100	0	100 EUR	98.15%	93'529.32	0.01 a)	
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	0	200	0	200 EUR	97.75%	186'281.08	0.02 a)	
XS1087831688	2.6250 % ACEIM 2 5/8 07/15/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1109741329	2.5000 % CMCSA 2 1/2 09/15/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.63%	93'030.96	0.01 a)	
XS1117297785	1.2500 % BLK 1 1/4 05/06/25	0	150	0	150 EUR	97.11%	138'804.62	0.02 a)	
XS1119021357	2.5000 % EXOIM 2 1/2 10/08/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1146286205	2.6250 % VZ 2 5/8 12/01/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1167667283	1.6250 % VW 1 5/8 01/16/30 EMTN	0	180	180	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1174469137	1.5000 % JPM 1 1/2 01/27/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1180451657	1.5000 % ENIIM 1 1/2 02/02/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1196503137	1.8000 % BKNG 1.8 03/03/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1197270819	1.6250 % MDLZ 1 5/8 03/08/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1200679071	1.1250 % BRK 1 1/8 03/16/27	350	100	0	450 EUR	93.46%	400'771.32	0.05 a)	
XS1200679667	1.6250 % BRK 1 5/8 03/16/35	250	0	0	250 EUR	83.49%	198'888.20	0.02 a)	
XS1202849086	1.7500 % GLENLN 1 3/4 03/17/25 EMTN	250	0	150	100 EUR	97.78%	93'169.13	0.01 a)	
XS1203859928	1.2500 % BATSLN 1 1/4 03/13/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.08%	88'694.39	0.01 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1204154410	2.6250 % ACAFP 2 5/8 03/17/27	200	0	0	200 EUR	95.88%	182'728.73	0.02	a)
XS1206541366	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	0	350	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1207058733	4.5000 % REPSM 4 1/2 03/25/2075	0	100	0	100 EUR	99.50%	94'811.90	0.01	a)
XS1209863254	1.3750 % BAC 1 3/8 03/26/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.47%	92'879.45	0.01	a)
XS1234953906	2.1250 % ITW 2 1/8 05/22/30	0	100	0	100 EUR	93.11%	88'722.02	0.01	a)
XS1254428896	3.0000 % HSBC 3 06/30/25 EMTN	0	750	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1310934382	2.0000 % WFC 2 04/27/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.24%	183'412.90	0.02	a)
XS1362384262	1.2000 % LIN 1.2 02/12/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1366026919	2.2500 % HON 2 1/4 02/22/28	120	100	0	220 EUR	96.14%	201'544.55	0.02	a)
XS1377679961	1.7500 % BRITEL 1 3/4 03/10/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.25%	183'420.52	0.02	a)
XS1382791975	1.5000 % DT 1 1/2 04/03/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.10%	88'712.49	0.01	a)
XS1395021089	1.2500 % ACAFP 1 1/4 04/14/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1396285279	1.5000 % EUROGR 1 1/2 04/18/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	91.72%	262'195.39	0.03	a)
XS1397134609	1.0000 % LIN 1 04/20/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1400169931	1.3750 % WFC 1 3/8 10/26/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.04%	179'210.68	0.02	a)
XS1402921412	1.5000 % JPM 1 1/2 10/29/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403264291	1.7500 % MCD 1 3/4 05/03/28 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405765733	1.2500 % DOV 1 1/4 11/09/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405766897	0.8750 % VZ 0 7/8 04/02/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405769487	0.8750 % PPG 0 7/8 11/03/25	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405775534	1.3750 % TMO 1 3/8 09/12/28	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405775708	0.7500 % TMO 0 3/4 09/12/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405784015	2.2500 % KHC 2 1/4 05/25/28	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1410582313	1.3750 % AIRFP 1 3/8 05/13/31 EMTN	300	0	100	200 EUR	87.58%	166'908.96	0.02	a)
XS1412417617	1.2500 % NAB 1 1/4 05/18/26 GMTN	0	100	0	100 EUR	95.77%	91'259.55	0.01	a)
XS1412711217	1.6250 % ENIIM 1 5/8 05/17/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1426022536	1.5460 % SUMIBK 1.546 06/15/26	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1432384664	1.0000 % TENN 1 06/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.62%	91'109.94	0.01	a)
XS1435056426	1.8500 % SO 1.85 06/20/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1456422135	0.6250 % JPM 0 5/8 01/25/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.36%	176'007.09	0.02	a)
XS1492825481	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 09/20/28	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1493322355	0.6250 % ENIIM 0 5/8 09/19/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1497312295	0.8750 % CKHH 0 7/8 10/03/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1505568136	1.2500 % TENN 1 1/4 10/24/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.59%	81'555.38	0.01	a)
XS1505884723	1.1250 % EZJLN 1 1/8 10/18/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1509006380	1.2500 % GS 1 1/4 05/01/25 EMTN	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1512827095	1.8750 % MRLSM 1 7/8 11/02/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1527526799	1.0000 % ADENVX 1 12/02/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1531347661	1.9000 % BDV 1.9 12/15/26	0	100	0	100 EUR	95.70%	91'187.13	0.01	a)
XS1532779748	2.4250 % ZBH 2.425 12/13/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1538284230	1.8750 % ACAFP 1 7/8 12/20/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550135831	1.0000 % ACAFP 1 09/16/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550149204	1.0000 % ENELIM 1 09/16/24 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1557095616	1.3750 % DT 1 3/8 01/30/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.73%	90'266.64	0.01	a)
XS1577951129	1.3750 % GMGAU 1 3/8 09/27/25 REGS	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1586555945	1.8750 % VW 1 7/8 03/30/27 10Y	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1587893451	3.3750 % HELNSW 3 3/8 09/29/47	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1602547264	1.7760 % BAC 1.776 05/04/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.67%	182'326.61	0.02	a)
XS1605365193	1.3750 % ACAFP 1 3/8 05/03/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1614416193	1.5000 % BNP 1 1/2 11/17/25 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1617830721	1.5000 % WFC 1 1/2 05/24/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.08%	88'691.53	0.01	a)
XS1619643015	1.7500 % MRLSM 1 3/4 05/26/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1621351045	1.3750 % EXPNLN 1 3/8 06/25/26 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1622421722	1.7500 % AKFAST 1 3/4 02/07/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1623404412	0.8500 % USB 0.85 06/07/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1627602201	1.8750 % AIG 1 7/8 06/21/27	100	0	0	100 EUR	94.05%	89'619.63	0.01	a)
XS1629774230	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1632897762	0.7500 % TENN 0 3/4 06/26/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.87%	92'305.81	0.01	a)
XS1632897929	1.3750 % TENN 1 3/8 06/26/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.93%	87'593.80	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1637333748	1.5000 % BRITEL 1 1/2 06/23/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.57%	89'164.16	0.01	a)
XS1642590480	1.3750 % VW 1 3/8 01/20/25 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1651071877	1.4000 % TMO 1.4 01/23/26	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1651072099	2.8750 % TMO 2 7/8 07/24/37	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1654229373	1.3750 % GYCGR 1 3/8 08/03/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1664644983	2.2500 % BATSLN 2 1/4 01/16/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.13%	257'650.14	0.03	a)
XS1675764945	0.8720 % MUFU 0.872 09/07/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1677912393	1.8750 % BALDER 1 7/8 01/23/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1689523840	1.1250 % BNRGR 1 1/8 09/27/25	0	100	0	100 EUR	95.83%	91'318.63	0.01	a)
XS1704789590	1.5000 % IREIM 1 1/2 10/24/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1708161291	1.3750 % VZ 1 3/8 10/27/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1716245094	1.8750 % PM 1 7/8 11/06/37	0	100	0	100 EUR	74.58%	71'064.14	0.01	a)
XS1720642138	0.6250 % TOYOTA 0 5/8 11/21/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1729879822	1.3750 % CASHSM 1 3/8 02/04/26 EMTN	0	200	100	100 EUR	95.41%	90'916.51	0.01	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1733289406	4.2500 % CASSIM 4 1/4 12/14/47	0	100	0	100 EUR	98.92%	94'261.13	0.01	a)
XS1734548644	1.2500 % VW 1 1/4 12/15/25 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1750122225	0.7500 % BFCM 0 3/4 07/17/25 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1753808929	1.7500 % EXOIM 1 3/4 01/18/28	100	0	0	100 EUR	94.26%	89'814.98	0.01	a)
XS1767087866	1.5000 % ACEIM 1 1/2 06/08/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1790990474	1.3750 % ACAFP 1 3/8 03/13/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1796208632	1.6250 % SESGFP 1 5/8 03/22/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799938995	3.3750 % VW 3 3/8 PERP NC6	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1801129286	2.1250 % VTRS 2 1/8 05/23/25	0	100	0	100 EUR	97.47%	92'875.64	0.01	a)
XS1811435251	1.6620 % BAC 1.662 04/25/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.69%	89'277.55	0.01	a)
XS1823300949	1.9500 % AMT 1.95 05/22/26	0	200	100	100 EUR	95.65%	91'138.53	0.01	a)
XS1823485039	1.0000 % OPBANK 1 05/22/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.64%	92'082.84	0.01	a)
XS1823518730	1.0000 % WURTH 1 05/26/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.70%	92'146.68	0.01	a)
XS1828032786	1.3750 % DT 1 3/8 12/01/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.55%	91'996.13	0.01	a)
XS1828033834	2.0000 % DT 2 12/01/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.49%	89'083.16	0.01	a)
XS1830986326	1.2500 % VW 1 1/4 06/10/24 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843434108	1.6250 % FI 1 5/8 07/01/30	200	0	0	200 EUR	87.90%	167'513.09	0.02	a)
XS1843434793	1.0000 % ITW 1 06/05/31	0	100	0	100 EUR	85.31%	81'293.34	0.01	a)
XS1843435170	0.6250 % ITW 0 5/8 12/05/27	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843435923	2.0000 % FIS 2 05/21/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843443190	2.2000 % MO 2.2 06/15/27	0	400	300	100 EUR	94.97%	90'497.24	0.01	a)
XS1843443513	1.7000 % MO 1.7 06/15/25	0	200	100	100 EUR	97.13%	92'552.61	0.01	a)
XS1843443786	3.1250 % MO 3 1/8 06/15/31	0	470	270	200 EUR	91.95%	175'231.44	0.02	a)
XS1843459600	2.2500 % WPC 2 1/4 04/09/26	250	0	0	250 EUR	96.02%	228'732.51	0.03	a)
XS1849518276	2.8750 % SKGID 2 7/8 01/15/26	0	100	0	100 EUR	98.03%	93'413.06	0.01	a)
XS1851268893	2.2000 % BPPEHX 2.2 07/24/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1861322383	1.8750 % PLD 1 7/8 01/05/29	0	100	0	100 EUR	92.03%	87'695.76	0.01	a)
XS1865186677	1.6250 % VW 1 5/8 08/15/25 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1872032799	1.3750 % NAB 1 3/8 08/30/28 GMTN	0	200	100	100 EUR	91.06%	86'764.80	0.01	a)
XS1883352095	1.1250 % JAPTOB 1 1/8 09/28/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.67%	91'160.45	0.01	a)
XS1890709774	0.9800 % MUFU 0.98 10/09/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1891336932	2.8750 % PLNIJ 2 7/8 10/25/25 REGS	0	150	0	150 EUR	98.00%	140'078.14	0.02	a)
XS1893631769	2.2500 % VW 2 1/4 10/16/26 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1898256257	1.0000 % SLB 1 02/18/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1910948162	2.6250 % VW 2 5/8 11/16/27	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1910948329	3.2500 % VW 3 1/4 11/18/30	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1910948675	4.1250 % VW 4 1/8 11/16/38	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1915689746	1.2500 % EMR 1 1/4 10/15/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1944390597	2.5000 % VW 2 1/2 07/31/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1951313763	2.1250 % IMBLN 2 1/8 02/12/27 EMTN	100	100	0	200 EUR	95.48%	181'954.99	0.02	a)
XS1958307461	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/05/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1960248919	1.0900 % JPM 1.09 03/11/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1963836892	1.3490 % MMC 1.349 09/21/26	0	200	100	100 EUR	94.35%	89'907.41	0.01	a)
XS1963837197	1.9790 % MMC 1.979 03/21/30	0	100	0	100 EUR	91.37%	87'068.77	0.01	a)
XS1966038249	1.3750 % TLSAU 1 3/8 03/26/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1968706108	2.0000 % ACAFP 2 03/25/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1972547696	2.2500 % VW 2 1/4 10/01/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1972548231	1.5000 % VW 1 1/2 10/01/24 EMTN	0	280	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1973750869	1.6250 % BACRED 1 5/8 01/07/25 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979280937	1.2500 % VZ 1 1/4 04/08/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979490239	1.5000 % BX 1 1/2 04/10/29 REGS	150	0	0	150 EUR	89.71%	128'223.32	0.01	a)
XS1986416698	1.5000 % SIKASW 1 1/2 04/29/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1991265395	1.3810 % BAC 1.381 05/09/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.46%	84'293.02	0.01	a)
XS1991265478	0.8080 % BAC 0.808 05/09/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.41%	91'864.63	0.01	a)
XS1992927902	1.2310 % BPLN 1.231 05/08/31 EMTN	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1995716211	3.3750 % SAMPFH 3 3/8 05/23/49	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1998798042	1.1250 % NAB 1 1/8 05/20/31 GMTN	0	100	0	100 EUR	87.45%	83'330.60	0.01	a)
XS2002491863	1.5000 % TENN 1 1/2 06/03/39 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.69%	79'744.90	0.01	a)
XS2002532724	1.2080 % BDX 1.208 06/04/26	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010045198	0.2500 % SLB 0 1/4 10/15/27	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010331440	1.6500 % COF 1.65 06/12/29	100	0	0	100 EUR	86.98%	82'884.66	0.01	a)
XS2012102674	0.8750 % CB 0 7/8 06/15/27	100	0	0	100 EUR	91.66%	87'340.34	0.01	a)
XS2012102914	1.4000 % CB 1.4 06/15/31	250	0	0	250 EUR	85.70%	204'162.41	0.02	a)
XS2013539635	1.0000 % SGTOPT 1 06/20/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.17%	82'109.01	0.01	a)
XS2014291616	1.5000 % VW 1 1/2 06/19/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2019815062	1.4000 % OMC 1.4 07/08/31 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2020568734	0.0500 % SEB 0.05 07/01/24 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2020581752	1.5000 % IAGLN 1 1/2 07/04/27	0	100	0	100 EUR	91.95%	87'620.49	0.01	a)
XS2024715794	0.5000 % DT 0 1/2 07/05/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.72%	174'789.30	0.02	a)
XS2024716099	1.3750 % DT 1 3/8 07/05/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.35%	79'419.97	0.01	a)
XS2027957815	1.1250 % BACRED 1 1/8 07/15/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	96.40%	137'791.22	0.02	a)
XS2035620710	0.2500 % REPSM 0 1/4 08/02/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.59%	85'369.77	0.01	a)
XS2038039074	0.5800 % BAC 0.58 08/08/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.34%	83'223.88	0.01	a)
XS2049090595	0.1250 % VGASDE 0 1/8 09/10/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.48%	79'545.75	0.01	a)
XS2049146215	0.5000 % VGASDE 0 1/2 09/10/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	71.90%	68'516.13	0.01	a)
XS2049582542	0.0500 % SHBASS 0.05 09/03/26	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	0	150	0	150 EUR	79.04%	112'978.14	0.01	a)
XS2049583789	1.5000 % PLD 1 1/2 09/10/49	0	100	0	100 EUR	57.99%	55'254.85	0.01	a)
XS2049630887	0.1180 % MIZUHO 0.118 09/06/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049823680	2.3750 % SBBSS 1 1/8 09/04/26 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049823680XXX	2.3750 % SBBSS 2 3/8 09/04/26 EMTN *RETIRED*	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050404636	0.2000 % DHR 0.2 03/18/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050406094	0.7500 % DHR 0 3/4 09/18/31	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050968333	1.5000 % SKGID 1 1/2 09/15/27	0	100	0	100 EUR	92.55%	88'191.26	0.01	a)
XS2051149552	1.8000 % DHR 1.8 09/18/49	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051494222	0.5000 % BRITEL 0 1/2 09/12/25 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051670300	1.7500 % BPPEHX 1 3/4 03/12/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.70%	204'150.50	0.02	a)
XS2052310054	0.8750 % LYB 0 7/8 09/17/26	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052313827	1.6250 % LYB 1 5/8 09/17/31	0	100	0	100 EUR	84.93%	80'927.43	0.01	a)
XS2054209833	0.8400 % WNTRDE 0.84 09/25/25	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2054210252	1.3320 % WNTRDE 1.332 09/25/28	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2055079904	1.8230 % WNTRDE 1.823 09/25/31	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056400299	0.6250 % WFC 0 5/8 03/25/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	82.79%	78'893.03	0.01	a)
XS2056430874	0.3750 % CONGR 0 3/8 06/27/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056572154	0.3750 % CKHGTH 0 3/8 10/17/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057069093	0.7500 % CKHGTH 0 3/4 04/17/26	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057069762	1.1250 % CKHGTH 1 1/8 10/17/28	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2057872595	0.2500 % SPOLNO 0 1/4 09/30/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2058557344	1.8750 % TMO 1 7/8 10/01/49 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2065946837	1.0000 % ENIIM 1 10/11/34 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2067135421	0.3750 % ACAFP 0 3/8 10/21/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2070192591	0.6250 % BSX 0 5/8 12/01/27	0	100	0	100 EUR	89.99%	85'747.12	0.01	a)
XS2075185228	0.9000 % HOG 0.9 11/19/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2075811948	1.0470 % JPM 1.047 11/04/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2078737215	0.6250 % SEB 0 5/8 11/12/29 EMTN	0	350	0	350 EUR	84.21%	280'851.42	0.03	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082472122	1.0000 % JAPTOB 1 11/26/29	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084418339	0.8750 % CEZCP 0 7/8 12/02/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2085608326	0.6250 % FIS 0 5/8 12/03/25	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2089226026	1.7500 % DT 1 3/4 12/09/49 EMTN	0	100	0	100 EUR	73.17%	69'725.34	0.01	a)
XS2090859252	0.8750 % BACRED 0 7/8 01/15/26	0	100	0	100 EUR	94.73%	90'270.45	0.01	a)
XS2099128055	0.8750 % CAIAV 0 7/8 02/05/27	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2102924383	0.6000 % OPBANK 0.6 01/18/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.99%	86'706.67	0.01	a)
XS2112475509	0.3750 % PLD 0 3/8 02/06/28	0	100	0	100 EUR	88.20%	84'043.36	0.01	a)
XS2114852218	0.2500 % CMCSA 0 1/4 05/20/27	0	100	0	100 EUR	90.32%	86'063.47	0.01	a)
XS2114852564	0.7500 % CMCSA 0 3/4 02/20/32	0	200	0	200 EUR	81.45%	155'220.89	0.02	a)
XS2114852721	1.2500 % CMCSA 1 1/4 02/20/40	0	100	0	100 EUR	73.87%	70'390.45	0.01	a)
XS2115094737	0.3750 % SEB 0 3/8 02/11/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	90.58%	345'248.71	0.04	a)
XS2118204200	0.6250 % WFC 0 5/8 08/14/30	0	250	0	250 EUR	81.91%	195'121.93	0.02	a)
XS2118213888	0.6250 % ANVAU 0 5/8 08/25/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	82.51%	157'241.00	0.02	a)
XS2121207828	0.5000 % SHBASS 0 1/2 02/18/30	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2122377281	0.1250 % LFBANK 0 1/8 02/19/25 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2148370211	3.6480 % BAC 3.648 03/31/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.34%	189'313.15	0.02	a)
XS2152061904	3.3750 % VW 3 3/8 04/06/28 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2152062209	3.0000 % VW 3 04/06/25 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156510021	1.0000 % SHBASS 1 04/15/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156581394	2.0000 % REPSM 2 12/15/25	0	100	0	100 EUR	97.11%	92'535.46	0.01	a)
XS2156583259	2.6250 % REPSM 2 5/8 04/15/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.66%	182'313.27	0.02	a)
XS2166755509	2.0000 % SLB 2 05/06/32	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2167007918	1.7410 % WFC 1.741 05/04/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.94%	85'698.52	0.01	a)
XS2170386853	1.2500 % RDSALN 1 1/4 11/11/32 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2171210862	0.3750 % HESLAN 0 3/8 05/12/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.42%	181'855.89	0.02	a)
XS2171253912	0.5000 % OPBANK 0 1/2 08/12/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.50%	136'504.83	0.02	a)
XS2171713006	1.1130 % EUROGR 1.113 05/15/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.86%	156'000.35	0.02	a)
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.79%	86'509.42	0.01	a)
XS2176560444	1.3000 % VZ 1.3 05/18/33	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2176785447	2.0000 % ENIIM 2 05/18/31 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182067350	2.2500 % SCANIA 2 1/4 06/03/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	0	100	0	100 EUR	96.34%	91'804.60	0.01	a)
XS2185867830	1.3750 % AIRFP 1 3/8 06/09/26 EMTN	400	100	100	400 EUR	95.44%	363'780.38	0.04	a)
XS2185868051	2.3750 % AIRFP 2 3/8 06/09/40 EMTN	250	0	150	100 EUR	83.09%	79'174.13	0.01	a)
XS2185997884	3.7500 % REPSM 3 3/4 PERP	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	0	100	0	100 EUR	96.63%	92'072.36	0.01	a)
XS2187689034	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2188805688	0.8750 % COVEGR 0 7/8 02/03/26 EMTN	0	150	50	100 EUR	94.69%	90'223.76	0.01	a)
XS2188805845	1.3750 % COVEGR 1 3/8 06/12/30 EMTN	0	150	50	100 EUR	88.06%	83'910.91	0.01	a)
XS2193669657	1.1250 % AMCR 1 1/8 06/23/27	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193982803	1.3620 % VTRS 1.362 06/23/27	0	300	200	100 EUR	91.47%	87'159.29	0.01	a)
XS2193983108	1.9080 % VTRS 1.908 06/23/32	0	200	0	200 EUR	81.37%	155'076.05	0.02	a)
XS2196322155	0.1420 % XOM 0.142 06/26/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2196322312	0.5240 % XOM 0.524 06/26/28	0	100	0	100 EUR	88.94%	84'745.64	0.01	a)
XS2196324011	1.4080 % XOM 1.408 06/26/39	300	0	100	200 EUR	70.90%	135'118.86	0.02	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	0	100	0	100 EUR	85.77%	81'731.67	0.01	a)
XS2197356186	1.0000 % IREIM 1 07/01/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2199604096	1.3750 % UQA 1 3/8 07/09/30	0	100	0	100 EUR	86.37%	82'296.73	0.01	a)
XS2201946634	2.3750 % MRLSM 2 3/8 07/13/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2207430120	2.3740 % TENN 2.374 PERP	0	100	0	100 EUR	96.55%	92'001.84	0.01	a)
XS2211183244	1.5390 % PRXNA 1.539 08/03/28 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2225890537	1.1250 % ATH 1 1/8 09/02/25 EMTN	0	200	100	100 EUR	95.49%	90'991.79	0.01	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.55%	79'614.36	0.01	a)
XS2227196404	1.0000 % BACRED 1 09/08/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.22%	86'923.93	0.01	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	0	100	0	100 EUR	88.17%	84'014.77	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2228892860	1.1250 % GLENLN 1 1/8 03/10/28 EMTN	150	100	150	100 EUR	90.22%	85'964.37	0.01	a)
XS2228897158	1.0000 % AKFAST 1 01/17/28 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2234567233	0.8750 % VW 0 7/8 09/22/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2234567662	1.2500 % VW 1 1/4 09/23/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2235987224	0.3750 % MDLZ 0 3/8 09/22/29 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2238783422	2.3750 % JAPTOB 2 3/8 04/07/2081	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2238783778	2.8750 % JAPTOB 2 7/8 10/07/2083	0	100	0	100 EUR	93.63%	89'213.71	0.01	a)
XS2241387096	0.6930 % MIZUHO 0.693 10/07/30 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2241387252	0.2140 % MIZUHO 0.214 10/07/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242929532	2.6250 % ENIIM 2 5/8 PERP NC5	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2248451978	0.6540 % BAC 0.654 10/26/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.36%	77'528.50	0.01	a)
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2251233651	1.1250 % AKFAST 1 1/8 01/11/29 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2258389415	0.1000 % OPBANK 0.1 11/16/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.26%	84'096.72	0.01	a)
XS2262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.42%	80'445.27	0.01	a)
XS2262065233	0.5000 % TENN 0 1/2 11/30/40 EMTN	0	100	0	100 EUR	77.59%	73'935.17	0.01	a)
XS2265968284	0.0100 % SHBASS 0.01 12/02/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2270150399	0.0500 % VW 0.05 06/10/24	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2271332285	0.7500 % SBBSS 0 3/4 12/14/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282094494	0.2500 % VW 0 1/4 01/12/26 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282095970	0.5000 % VW 0 1/2 01/12/29 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282101539	0.1250 % GYCGR 0 1/8 01/11/28 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282101539XXX	0.1250 % *RETIRED*	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	0	100	0	100 EUR	87.95%	83'802.28	0.01	a)
XS2283188683	0.8750 % EXOIM 0 7/8 01/19/31	100	0	0	100 EUR	83.40%	79'471.43	0.01	a)
XS2288925568	1.0000 % BALDER 1 01/20/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2292487076	0.2500 % ACEIM 0 1/4 07/28/30 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	0	100	0	100 EUR	77.08%	73'443.49	0.01	a)
XS2296206068	1.0000 % PLD 1 02/16/41	0	100	0	100 EUR	61.50%	58'598.52	0.01	a)
XS2298459426	1.2130 % BDX 1.213 02/12/36	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2301127119	0.7500 % AKFAST 0 3/4 02/22/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2304340263	0.2500 % EQIX 0 1/4 03/15/27	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2304340693	1.0000 % EQIX 1 03/15/33	0	100	0	100 EUR	79.38%	75'642.74	0.01	a)
XS2306082293	0.9500 % WPC 0.95 06/01/30	100	0	0	100 EUR	82.13%	78'263.17	0.01	a)
XS2306601746	1.8750 % EZJLN 1 7/8 03/03/28 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2307764311	1.2500 % GLENLN 1 1/4 03/01/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.32%	75'579.85	0.01	a)
XS2310797696	1.1250 % SPG 1 1/8 03/19/33	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2312723138	0.7500 % MDLZ 0 3/4 03/17/33	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2320533131	2.5000 % REPSM 2 1/2 PERP	0	100	0	100 EUR	93.13%	88'737.26	0.01	a)
XS2320747285	0.2500 % OPBANK 0 1/4 03/24/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.98%	88'596.24	0.01	a)
XS2320759884	0.7500 % VZ 0 3/4 03/22/32	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2321427408	0.6940 % BAC 0.694 03/22/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.07%	79'152.21	0.01	a)
XS2322423539	3.7500 % IAGLN 3 3/4 03/25/29	0	100	0	100 EUR	97.23%	92'647.90	0.01	a)
XS2329144591	0.8430 % MIZUHO 0.843 04/12/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332179725	0.0500 % LFBANK 0.05 04/15/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.17%	87'828.21	0.01	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2334857138	2.7500 % ENIIM 2 3/4 PERP NC9	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2341269970	1.1250 % AKERBP 1 1/8 05/12/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.92%	82'826.53	0.01	a)
XS2342732562	3.7480 % VW 3.748 PERP	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343821794	0.0000 % VW 0 07/19/24 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343822503	0.6250 % VW 0 5/8 07/19/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343822842	0.3750 % VW 0 3/8 07/20/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2344385815	0.8750 % RYAIID 0 7/8 05/25/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	93.87%	223'608.38	0.03	a)
XS2345798271	1.1020 % BAC 1.102 05/24/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	82.49%	78'605.26	0.01	a)
XS2345799089	0.5830 % BAC 0.583 08/24/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.59%	85'371.68	0.01	a)
XS2346124410	0.3750 % HESLAN 0 3/8 06/04/29 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346206902	0.4500 % AMT 0.45 01/15/27	0	100	0	100 EUR	90.93%	86'642.83	0.01	a)
XS2346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	0	150	0	150 EUR	86.01%	122'939.11	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52346208197	1.2500 % AMT 1 1/4 05/21/33	0	100	0	100 EUR	78.45%	74'755.61	0.01	a)
X52348325494	0.5000 % TENN 0 1/2 06/09/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.70%	82'613.08	0.01	a)
X52354246816	0.3750 % OPBANK 0 3/8 06/16/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.72%	82'635.95	0.01	a)
X52355632741	1.3750 % TVOYFH 1 3/8 06/23/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.19%	85'938.65	0.01	a)
X52356049069	0.3750 % SEB 0 3/8 06/21/28 GMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	200	0	200 EUR	84.49%	161'010.61	0.02	a)
X52356569736	1.0000 % BYLAN 1 09/23/31 EMTN	0	200	100	100 EUR	87.47%	83'350.62	0.01	a)
X52358343833	0.0000 % CCB 0 06/28/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52360853332	1.2880 % PRXNA 1.288 07/13/29 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52363203089	1.9850 % PRXNA 1.985 07/13/33 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52374594823	0.3750 % VW 0 3/8 02/12/30 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52374595044	0.1250 % VW 0 1/8 02/12/27 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52374595127	0.0000 % VW 0 02/12/25 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52375844144	0.3340 % BDX 0.334 08/13/28	0	100	0	100 EUR	87.13%	83'026.63	0.01	a)
X52375844656	1.3360 % BDX 1.336 08/13/41	0	100	0	100 EUR	67.27%	64'104.28	0.01	a)
X52383901761	0.4700 % MIZUHO 0.47 09/06/29	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52384413311	0.3660 % ATH 0.366 09/10/26 EMTN	0	200	100	100 EUR	91.35%	87'045.90	0.01	a)
X52384473992	0.3750 % OPBANK 0 3/8 12/08/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.02%	81'010.33	0.01	a)
X52384726449	1.2500 % MDLZ 1 1/4 09/09/41 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52385397901	0.0000 % CMCSA 0 09/14/26	0	100	0	100 EUR	91.55%	87'234.57	0.01	a)
X52385398206	0.2500 % CMCSA 0 1/4 09/14/29	0	100	0	100 EUR	84.20%	80'229.92	0.01	a)
X52388182573	0.5000 % SKGID 0 1/2 09/22/29	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388183381	1.0000 % SKGID 1 09/22/33	0	100	0	100 EUR	78.59%	74'890.92	0.01	a)
X52393701953	0.9500 % AMT 0.95 10/05/30	0	100	0	100 EUR	83.45%	79'518.12	0.01	a)
X52394063437	0.5000 % BNRGR 0 1/2 10/06/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.55%	80'561.53	0.01	a)
X52402178300	0.7500 % CKHH 0 3/4 11/02/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52402178565	1.0000 % CKHH 1 11/02/33	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52404247384	0.7500 % SEB 0 3/4 11/03/31 GMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52406569579	0.8750 % TENN 0 7/8 06/16/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.10%	79'184.61	0.01	a)
X52411178630	1.3750 % BYLAN 1 3/8 11/22/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.72%	79'778.26	0.01	a)
X52411241693	1.7500 % TALANX 1 3/4 12/01/42	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52430970884	0.8320 % ATH 0.832 01/08/27 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52431320378	1.0000 % BACRED 1 07/17/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.71%	84'532.19	0.01	a)
X52438026366	1.2500 % THAMES 1 1/4 01/31/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	74.39%	141'760.46	0.02	a)
X52438615606	0.2500 % VW 0 1/4 01/31/25 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52438616240	0.8750 % VW 0 7/8 01/31/28 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52439004412	1.0000 % PLD 1 02/08/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	88.13%	125'962.13	0.01	a)
X52439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	0	100	0	100 EUR	79.97%	76'198.27	0.01	a)
X52442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.14%	171'780.10	0.02	a)
X52444263102	1.5600 % EXPNLN 1.56 05/16/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.74%	83'602.18	0.01	a)
X52452433910	1.3750 % BSX 1 3/8 03/08/28	0	100	0	100 EUR	92.31%	87'959.71	0.01	a)
X52452434645	1.6250 % BSX 1 5/8 03/08/31	0	100	0	100 EUR	88.26%	84'104.35	0.01	a)
X52452435295	1.8750 % BSX 1 7/8 03/08/34	0	100	0	100 EUR	84.82%	80'818.80	0.01	a)
X52454766473	0.7500 % BSX 0 3/4 03/08/25	0	350	250	100 EUR	96.98%	92'413.49	0.01	a)
X52462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.20%	175'709.79	0.02	a)
X52462324232	1.9490 % BAC 1.949 10/27/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.00%	184'859.38	0.02	a)
X52463934864	2.6250 % TVOYFH 2 5/8 03/31/27 EMTN	0	250	150	100 EUR	96.11%	91'577.81	0.01	a)
X52465984107	1.6310 % MIZUHO 1.631 04/08/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52477935345	1.6250 % TENN 1 5/8 11/17/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.14%	183'212.79	0.02	a)
X52478299204	2.1250 % TENN 2 1/8 11/17/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.78%	90'311.43	0.01	a)
X52478299469	2.7500 % TENN 2 3/4 05/17/42 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.13%	85'880.52	0.01	a)
X52478690931	1.7500 % SEB 1 3/4 11/11/26 GMTN	0	200	100	100 EUR	95.33%	90'842.18	0.01	a)
X52479941499	1.5000 % V 1 1/2 06/15/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52479941572	2.0000 % V 2 06/15/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52480515662	2.1250 % WURTH 2 1/8 08/23/30	0	100	0	100 EUR	92.65%	88'283.69	0.01	a)
X52481287808	2.2500 % COLOBD 2 1/4 05/19/27 EMTN	0	170	170	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52481288525	2.7500 % COLOBD 2 3/4 05/19/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.55%	90'097.98	0.01	a)
X52484111047	2.1250 % NAB 2 1/8 05/24/28 GMTN	0	100	0	100 EUR	94.79%	90'320.96	0.01	a)
X52486285294	2.3750 % MCD 2 3/8 05/31/29 GMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52486285377	3.0000 % MCD 3 05/31/34 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2489772991	4.5000 % HESLAN 4 1/2 09/15/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.23%	87'879.67	0.01	a)
XS2496028502	2.7500 % BRITEL 2 3/4 08/30/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	97.19%	138'911.82	0.02	a)
XS2496288593	3.0000 % UNIMUS 3 06/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.08%	186'913.79	0.02	a)
XS2521013909	3.6250 % CNUNZ 3 5/8 09/07/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2531420730	2.6250 % ALLRNV 2 5/8 09/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.80%	93'190.09	0.01	a)
XS2535724772	4.0000 % VGASDE 4 09/26/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.96%	96'205.96	0.01	a)
XS2535725159	4.6250 % VGASDE 4 5/8 09/26/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2547609433	4.0000 % TALANX 4 10/25/29 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549543499	4.5000 % TENN 4 1/2 10/28/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	106.43%	304'246.13	0.03	a)
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2552362704	4.7000 % GWOCN 4.7 11/16/29	0	200	100	100 EUR	104.49%	99'562.97	0.01	a)
XS2553798443	4.0000 % SEB 4 11/09/26	0	200	100	100 EUR	100.42%	95'691.41	0.01	a)
XS2554997937	4.7500 % COVEGR 4 3/4 11/15/28 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2558953621	3.2500 % SEB 3 1/4 11/24/25 GMTN	0	100	0	100 EUR	99.22%	94'548.90	0.01	a)
XS2563002653	4.6250 % BACRED 4 5/8 02/07/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.16%	98'296.59	0.01	a)
XS2575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	0	300	200	100 EUR	100.37%	95'638.05	0.01	a)
XS2576550326	4.0000 % THAMES 4 04/18/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.87%	90'401.00	0.01	a)
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.09%	87'751.03	0.01	a)
XS2582195207	4.0000 % HESLAN 4 02/04/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.72%	94'069.60	0.01	a)
XS2582814039	3.7500 % BRITEL 3 3/4 05/13/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.76%	95'059.65	0.01	a)
XS2583600791	3.7500 % SEB 3 3/4 02/07/28 GMTN	0	250	150	100 EUR	99.66%	94'962.45	0.01	a)
XS2583644146	4.4770 % ORIX 4.477 06/01/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2585932275	3.5530 % BDX 3.553 09/13/29	0	100	0	100 EUR	99.69%	94'989.13	0.01	a)
XS2597696124	4.0000 % DNBNO 4 03/14/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597994065	4.8750 % GPN 4 7/8 03/17/31	0	300	200	100 EUR	102.83%	97'984.05	0.01	a)
XS2597999452	4.7500 % BACRED 4 3/4 03/14/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.39%	97'565.73	0.01	a)
XS2598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2599779597	4.2500 % NESVFH 4 1/4 03/16/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	104.36%	149'157.22	0.02	a)
XS2611221032	6.6250 % PTSB 6 5/8 04/25/28	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2619751576	3.8750 % SEB 3 7/8 05/09/28 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2625194225	4.7500 % TVOYFH 4 3/4 06/01/30 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2635647154	3.2500 % ALLRNV 3 1/4 06/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.87%	95'160.65	0.01	a)
XS2641927574	6.6250 % PTSB 6 5/8 06/30/29	0	100	0	100 EUR	107.38%	102'315.85	0.01	a)
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.32%	146'251.40	0.02	a)
XS2676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	0	200	100	100 EUR	103.32%	98'448.10	0.01	a)
XS2677668357	4.8750 % IMCDNA 4 7/8 09/18/28	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EUR							34'024'482.76	3.84	
XS0158715713	5.9000 % VOD 5.9 11/26/32 EMTN	0	200	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1023626671	4.2500 % GS 4 1/4 01/29/26 EMTN	0	200	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2335966557	1.8950 % JPM 1.895 04/28/33 EMTN	0	200	200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GBP							0.00	0.00	
IL0028103310	6.3750 % ICLIT 6 3/8 05/31/38	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US001055AY85	4.7500 % AFL 4 3/4 01/15/49	0	306	0	306 USD	90.25%	243'178.17	0.03	a)
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	0	306	0	306 USD	92.80%	250'043.71	0.03	a)
US00108WAM29	2.1000 % AEP 2.1 07/01/30 I	0	474	0	474 USD	82.77%	345'454.32	0.04	a)
US00108WAQ33	5.2500 % AEP 5 1/4 05/15/52	0	360	0	360 USD	94.04%	298'116.97	0.03	a)
US00115AAP49	4.5000 % AEP 4 1/2 06/15/52 O	0	122	0	122 USD	86.31%	92'715.93	0.01	a)
US00206RCU41	5.6500 % T 5.65 02/15/47	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RGQ92	4.3000 % T 4.3 02/15/30	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00206RJK17	2.3000 % T 2.3 06/01/27	0	710	710	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00440EAV92	3.3500 % CB 3.35 05/03/26	0	180	0	180 USD	96.55%	153'027.30	0.02	a)
US00440EAW75	4.3500 % CB 4.35 11/03/45	0	526	0	526 USD	88.36%	409'239.26	0.05	a)
US00817YAF51	6.6250 % AET 6 5/8 06/15/36	0	252	0	252 USD	108.59%	240'957.47	0.03	a)
US00817YAZ16	3.8750 % AET 3 7/8 08/15/47	0	153	0	153 USD	74.85%	100'845.75	0.01	a)
US00928QAS03	4.2500 % AYR 4 1/4 06/15/26	0	410	310	100 USD	96.98%	85'398.20	0.01	a)
US010392FR41	3.7000 % SO 3.7 12/01/47 B	0	60	0	60 USD	76.87%	40'614.00	0.00	a)
US010392FS24	4.3000 % SO 4.3 07/15/48 A	410	0	0	410 USD	84.96%	306'733.40	0.03	a)
US01609WAQ50	3.6000 % BABA 3.6 11/28/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAU62	4.0000 % BABA 4 12/06/37	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAV46	4.2000 % BABA 4.2 12/06/47	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US01609WAZ59	3.1500 % BABA 3.15 02/09/51	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US020002AS04	5.5500 % ALL 5.55 05/09/35	0	108	0	108 USD	101.13%	96'177.55	0.01	a)
US020002BA86	4.5000 % ALL 4 1/2 06/15/43	0	184	0	184 USD	86.65%	140'389.75	0.02	a)
US020002BC43	4.2000 % ALL 4.2 12/15/46	0	144	0	144 USD	81.50%	103'344.14	0.01	a)
US020002BD26	3.2800 % ALL 3.28 12/15/26	0	245	0	245 USD	95.50%	206'029.71	0.02	a)
US020002BK68	5.2500 % ALL 5 1/4 03/30/33	0	158	0	158 USD	99.63%	138'610.74	0.02	a)
US02005NAV29	5.1250 % ALLY 5 1/8 09/30/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02005NBQ25	4.7500 % ALLY 4 3/4 06/09/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SAM52	4.2500 % MO 4 1/4 08/09/42	0	300	0	300 USD	79.59%	210'238.36	0.02	a)
US02209SAQ66	4.5000 % MO 4 1/2 05/02/43	0	250	150	100 USD	82.98%	73'069.01	0.01	a)
US02209SAR40	5.3750 % MO 5 3/8 01/31/44	0	500	250	250 USD	97.06%	213'666.56	0.02	a)
US02209SAU78	2.6250 % MO 2 5/8 09/16/26	0	250	200	50 USD	93.98%	41'375.55	0.00	a)
US02209SAV51	3.8750 % MO 3 7/8 09/16/46	0	350	200	150 USD	72.88%	96'264.24	0.01	a)
US02209SBC61	4.4000 % MO 4.4 02/14/26	0	400	300	100 USD	98.55%	86'778.82	0.01	a)
US02209SBD45	4.8000 % MO 4.8 02/14/29	0	400	250	150 USD	98.27%	129'795.36	0.01	a)
US02209SBF92	5.9500 % MO 5.95 02/14/49	0	1'040	700	340 USD	99.18%	296'934.72	0.03	a)
US02209SBJ15	3.4000 % MO 3.4 05/06/30	0	500	300	200 USD	89.99%	158'488.61	0.02	a)
US02209SBL60	2.4500 % MO 2.45 02/04/32	0	850	700	150 USD	80.09%	105'788.44	0.01	a)
US023135AP19	4.8000 % AMZN 4.8 12/05/34	0	1'196	400	796 USD	99.70%	698'796.82	0.08	a)
US023135AQ91	4.9500 % AMZN 4.95 12/05/44	0	306	0	306 USD	98.36%	265'039.59	0.03	a)
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	973	0	973 USD	94.91%	813'185.00	0.09	a)
US023135BF28	3.8750 % AMZN 3 7/8 08/22/37	0	645	0	645 USD	88.94%	505'150.89	0.06	a)
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	0	650	0	650 USD	85.49%	489'318.16	0.06	a)
US023135BM78	4.2500 % AMZN 4 1/4 08/22/57	0	647	400	247 USD	85.88%	186'792.83	0.02	a)
US023135BS49	1.5000 % AMZN 1 1/2 06/03/30	0	643	0	643 USD	82.61%	467'710.49	0.05	a)
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	0	889	0	889 USD	62.79%	491'563.31	0.06	a)
US023135BU94	2.7000 % AMZN 2.7 06/03/60	0	306	100	206 USD	61.48%	111'520.24	0.01	a)
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	0	475	0	475 USD	88.67%	370'878.11	0.04	a)
US023135BZ81	2.1000 % AMZN 2.1 05/12/31	0	764	0	764 USD	83.87%	564'237.30	0.06	a)
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	0	360	140	220 USD	69.12%	133'905.38	0.02	a)
US023135CF19	3.3000 % AMZN 3.3 04/13/27	0	644	0	644 USD	95.86%	543'586.55	0.06	a)
US023135CH74	3.6000 % AMZN 3.6 04/13/32	0	524	0	524 USD	92.15%	425'169.66	0.05	a)
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	0	360	0	360 USD	82.58%	261'771.56	0.03	a)
US023135CK04	4.1000 % AMZN 4.1 04/13/62	0	326	180	146 USD	82.73%	106'363.21	0.01	a)
US023135CP90	4.5500 % AMZN 4.55 12/01/27	0	360	0	360 USD	99.52%	315'484.02	0.04	a)
US023135CQ73	4.6500 % AMZN 4.65 12/01/29	0	504	0	504 USD	100.12%	444'329.76	0.05	a)
US02364WAJ45	6.3750 % AMXLMM 6 3/8 03/01/35	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025537AU52	3.8750 % AEP 3 7/8 02/15/62	0	144	0	144 USD	89.44%	113'406.29	0.01	a)
US025537AX91	5.6250 % AEP 5 5/8 03/01/33	0	288	0	288 USD	100.93%	255'963.46	0.03	a)
US026874DA29	4.5000 % AIG 4 1/2 07/16/44	0	336	0	336 USD	87.17%	257'897.06	0.03	a)
US026874DC84	3.8750 % AIG 3 7/8 01/15/35	0	209	0	209 USD	87.92%	161'802.43	0.02	a)
US026874DL83	4.7500 % AIG 4 3/4 04/01/48	0	153	0	153 USD	90.17%	121'478.07	0.01	a)
US026874DP97	4.3750 % AIG 4 3/8 06/30/50	0	209	0	209 USD	84.41%	155'349.98	0.02	a)
US026874DS37	5.1250 % AIG 5 1/8 03/27/33	0	275	0	275 USD	98.82%	239'303.31	0.03	a)
US03076CAH97	2.8750 % AMP 2 7/8 09/15/26	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03076CAL00	4.5000 % AMP 4 1/2 05/13/32	0	120	120	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162BE93	4.9500 % AMGN 4.95 10/01/41	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162BK53	5.1500 % AMGN 5.15 11/15/41	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162BV19	3.6250 % AMGN 3 5/8 05/22/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162BZ23	4.4000 % AMGN 4.4 05/01/45	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CF59	4.6630 % AMGN 4.663 06/15/51	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CJ71	2.6000 % AMGN 2.6 08/19/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CU27	2.4500 % AMGN 2.45 02/21/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03522AAH32	4.7000 % ABIBB 4.7 02/01/36	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	0	650	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US037735CM71	7.0000 % AEP 7 04/01/38	0	36	0	36 USD	112.00%	35'504.82	0.00	a)
US037735CZ84	2.7000 % AEP 2.7 04/01/31 AA	0	144	0	144 USD	84.41%	107'034.12	0.01	a)
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03938JAA79	5.1440 % ACGL 5.144 11/01/43	0	61	0	61 USD	93.00%	49'952.47	0.01	a)
US03939AAA51	3.6350 % ACGL 3.635 06/30/50	0	144	0	144 USD	73.22%	92'838.83	0.01	a)
US03939CAA18	4.0110 % ACGL 4.011 12/15/26	0	122	0	122 USD	96.40%	103'564.02	0.01	a)
US04686JAC53	3.5000 % ATH 3 1/2 01/15/31	400	60	200	260 USD	86.64%	198'362.63	0.02	a)
US049560AL95	4.1500 % ATO 4.15 01/15/43	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US049560AN51	3.0000 % ATO 3 06/15/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US049560AW50	2.8500 % ATO 2.85 02/15/52	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05526DAZ87	3.2220 % BATSLN 3.222 08/15/24	810	0	810	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05526DBB01	3.5570 % BATSLN 3.557 08/15/27	0	90	0	90 USD	94.28%	74'717.22	0.01	a)
US05526DBD66	4.3900 % BATSLN 4.39 08/15/37	0	100	0	100 USD	81.59%	71'839.67	0.01	a)
US05526DBF15	4.5400 % BATSLN 4.54 08/15/47	0	115	0	115 USD	75.01%	75'959.09	0.01	a)
US05526DBN49	4.9060 % BATSLN 4.906 04/02/30	0	90	0	90 USD	96.82%	76'729.68	0.01	a)
US05526DBS36	2.7260 % BATSLN 2.726 03/25/31	810	90	0	900 USD	82.36%	652'691.75	0.07	a)
US055451AR98	4.1250 % BHP 4 1/8 02/24/42	0	800	600	200 USD	86.25%	151'894.88	0.02	a)
US055451AV01	5.0000 % BHP 5 09/30/43	0	670	370	300 USD	95.75%	252'937.99	0.03	a)
US06051GJS93	1.7340 % BAC 1.734 07/22/27	0	420	420	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06417XAG60	4.5880 % BNS 4.588 05/04/37	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06849RAG74	5.7000 % ABXCN 5.7 05/30/41	0	200	0	200 USD	101.42%	178'603.19	0.02	a)
US06849RAK86	5.7500 % ABXCN 5 3/4 05/01/43	0	410	310	100 USD	102.22%	90'011.23	0.01	a)
US075887BG35	4.6850 % BDX 4.685 12/15/44	0	288	0	288 USD	90.10%	228'504.58	0.03	a)
US075887CJ64	2.8230 % BDX 2.823 05/20/30	0	660	0	660 USD	87.76%	510'032.72	0.06	a)
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	0	642	0	642 USD	81.28%	459'468.40	0.05	a)
US084659AR23	4.4500 % BRKHEC 4.45 01/15/49	400	100	0	500 USD	84.29%	371'087.10	0.04	a)
US084664BU46	4.4000 % BRK 4.4 05/15/42	530	120	0	650 USD	91.93%	526'151.08	0.06	a)
US084664CQ25	4.2000 % BRK 4.2 08/15/48	410	90	0	500 USD	87.55%	385'452.84	0.04	a)
US084664CR08	4.2500 % BRK 4 1/4 01/15/49	400	0	200	200 USD	87.69%	154'427.16	0.02	a)
US084664CV10	2.8500 % BRK 2.85 10/15/50	410	0	0	410 USD	66.06%	238'487.67	0.03	a)
US09261HAD98	2.6250 % BCRED 2 5/8 12/15/26	0	150	0	150 USD	90.24%	119'189.53	0.01	a)
US09261HAR84	4.0000 % BCRED 4 01/15/29	0	150	0	150 USD	90.70%	119'796.32	0.01	a)
US096630AH15	3.4000 % BWP 3.4 02/15/31	400	30	0	430 USD	88.52%	335'155.02	0.04	a)
US097023CN34	2.9500 % BA 2.95 02/01/30	400	0	0	400 USD	87.39%	307'805.41	0.03	a)
US097023CT04	4.8750 % BA 4 7/8 05/01/25	810	100	500	410 USD	98.96%	357'257.48	0.04	a)
US097023CV59	5.7050 % BA 5.705 05/01/40	400	100	0	500 USD	97.09%	427'461.68	0.05	a)
US097023CW33	5.8050 % BA 5.805 05/01/50	1'220	86	400	906 USD	96.11%	766'768.66	0.09	a)
US097023CY98	5.1500 % BA 5.15 05/01/30	800	100	450	450 USD	98.33%	389'620.66	0.04	a)
US097023DC69	3.6250 % BA 3 5/8 02/01/31	400	100	0	500 USD	89.50%	394'036.88	0.04	a)
US097023DG73	2.1960 % BA 2.196 02/04/26	400	0	0	400 USD	93.56%	329'524.00	0.04	a)
US101137BA41	2.6500 % BSX 2.65 06/01/30	0	650	0	650 USD	87.53%	500'973.64	0.06	a)
US10922NAC74	3.7000 % BHF 3.7 06/22/27	0	360	0	360 USD	94.04%	298'108.72	0.03	a)
US10922NAF06	4.7000 % BHF 4.7 06/22/47	0	306	0	306 USD	77.12%	207'794.76	0.02	a)
US11271LAB80	4.7000 % BNCN 4.7 09/20/47	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US11271LAD47	4.8500 % BNCN 4.85 03/29/29	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12503MAA62	3.6500 % CBOE 3.65 01/12/27	240	0	240	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12572QAG01	3.0000 % CME 3 03/15/25	250	0	150	100 USD	97.74%	86'068.39	0.01	a)
US12572QAH83	4.1500 % CME 4.15 06/15/48	400	40	200	240 USD	86.08%	181'912.68	0.02	a)
US12625GAG91	3.3000 % CNOOC 3.3 09/30/49	0	200	0	200 USD	74.08%	130'469.33	0.01	a)
US12634MAE03	4.3750 % CNOOC 4 3/8 05/02/28	0	200	0	200 USD	98.38%	173'255.61	0.02	a)
US126650CD09	5.3000 % CVS 5.3 12/05/43	0	153	0	153 USD	93.44%	125'880.86	0.01	a)
US126650CM08	4.8750 % CVS 4 7/8 07/20/35	0	360	300	60 USD	95.21%	50'302.56	0.01	a)
US126650CN80	5.1250 % CVS 5 1/8 07/20/45	0	621	260	361 USD	90.98%	289'219.25	0.03	a)
US126650CU24	2.8750 % CVS 2 7/8 06/01/26	0	360	0	360 USD	95.07%	301'358.27	0.03	a)
US126650CX62	4.3000 % CVS 4.3 03/25/28	0	1'450	0	1'450 USD	97.11%	1'239'913.37	0.14	a)
US126650CY46	4.7800 % CVS 4.78 03/25/38	0	1'102	600	502 USD	91.28%	403'489.67	0.05	a)
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	0	1'694	850	844 USD	89.07%	661'918.50	0.07	a)
US126650DF48	3.0000 % CVS 3 08/15/26	0	306	0	306 USD	94.94%	255'813.68	0.03	a)
US126650DG21	3.2500 % CVS 3 1/4 08/15/29	0	360	0	360 USD	91.02%	288'537.60	0.03	a)
US126650DK33	4.1250 % CVS 4 1/8 04/01/40	0	178	0	178 USD	82.42%	129'183.54	0.01	a)
US126650DL16	4.2500 % CVS 4 1/4 04/01/50	0	158	80	78 USD	80.38%	55'205.46	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US126650DN71	1.7500 % CVS 1 3/4 08/21/30	0	360	0	360 USD	81.16%	257'261.95	0.03	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	0	360	0	360 USD	80.39%	254'825.82	0.03	a)
US126650DT42	5.1250 % CVS 5 1/8 02/21/30	0	310	0	310 USD	99.40%	271'319.30	0.03	a)
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	324	0	324 USD	99.07%	282'635.22	0.03	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	367	250	117 USD	96.95%	99'879.63	0.01	a)
US126650DW70	5.0000 % CVS 5 01/30/29	0	180	0	180 USD	99.63%	157'917.63	0.02	a)
US126650DY37	5.3000 % CVS 5.3 06/01/33	0	216	0	216 USD	99.06%	188'402.75	0.02	a)
US126650DZ02	5.8750 % CVS 5 7/8 06/01/53	0	252	100	152 USD	99.95%	133'778.28	0.02	a)
US126650EA42	6.0000 % CVS 6 06/01/63	0	158	80	78 USD	100.48%	69'009.69	0.01	a)
US127097AG80	3.9000 % CTRA 3.9 05/15/27	200	50	0	250 USD	96.13%	211'607.61	0.02	a)
US14040HBG92	3.2000 % COF 3.2 02/05/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HBJ32	4.2000 % COF 4.2 10/29/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HBK05	3.7500 % COF 3 3/4 07/28/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HBT14	3.3000 % COF 3.3 10/30/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HBW43	3.8000 % COF 3.8 01/31/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14040HCA14	3.9000 % COF 3.9 01/29/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAL86	6.0500 % CE 6.05 03/15/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAM69	6.1650 % CE 6.165 07/15/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAN43	6.3300 % CE 6.33 07/15/29	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAP90	6.3790 % CE 6.379 07/15/32	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAR56	5.9000 % CE 5.9 07/05/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAV36	3.3750 % CNC 3 3/8 02/15/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAW19	3.0000 % CNC 3 10/15/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAX91	2.5000 % CNC 2 1/2 03/01/31	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAZ40	2.6250 % CNC 2 5/8 08/01/31	200	500	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BL78	5.3750 % CHTR 5 3/8 05/01/47	610	0	610	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BM51	5.3750 % CHTR 5 3/8 04/01/38	490	0	490	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BN35	5.7500 % CHTR 5 3/4 04/01/48	935	0	935	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US161175BU77	2.8000 % CHTR 2.8 04/01/31	815	0	815	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16411RAK59	4.6250 % LNG 4 5/8 10/15/28	0	360	0	360 USD	95.92%	304'064.48	0.03	a)
US16412XAG07	5.1250 % CHCOCH 5 1/8 06/30/27	0	360	0	360 USD	99.38%	315'016.76	0.04	a)
US16412XAJ46	3.7000 % CHCOCH 3.7 11/15/29	0	306	0	306 USD	92.13%	248'229.25	0.03	a)
US171232AQ41	6.0000 % CB 6 05/11/37	0	642	0	642 USD	107.07%	605'258.12	0.07	a)
US171232AS07	6.5000 % CB 6 1/2 05/15/38 1	0	85	0	85 USD	112.45%	84'163.52	0.01	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US174610AR61	2.8500 % CFG 2.85 07/27/26	0	360	70	290 USD	93.36%	238'403.12	0.03	a)
US174610AT28	3.2500 % CFG 3 1/4 04/30/30	0	410	310	100 USD	86.42%	76'101.18	0.01	a)
US20030NBH35	4.2500 % CMCSA 4 1/4 01/15/33	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NBP50	4.4000 % CMCSA 4.4 08/15/35	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NDU28	2.9370 % CMCSA 2.937 11/01/56	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAD12	3.6500 % CRBG 3.65 04/05/27	0	360	0	360 USD	94.95%	300'980.73	0.03	a)
US21871XAH26	3.9000 % CRBG 3.9 04/05/32	0	464	0	464 USD	87.93%	359'268.34	0.04	a)
US21871XAM11	4.4000 % CRBG 4.4 04/05/52	0	306	0	306 USD	80.15%	215'972.52	0.02	a)
US21871XAQ25	6.0500 % CRBG 6.05 09/15/33 144A	0	108	0	108 USD	102.17%	97'163.06	0.01	a)
US22822VAC54	3.7000 % CCI 3.7 06/15/26	0	300	50	250 USD	96.17%	211'713.06	0.02	a)
US22822VAH42	3.6500 % CCI 3.65 09/01/27	0	450	210	240 USD	94.45%	199'607.51	0.02	a)
US22822VAK70	3.8000 % CCI 3.8 02/15/28	0	440	310	130 USD	93.93%	107'523.19	0.01	a)
US22822VAL53	4.3000 % CCI 4.3 02/15/29	0	360	180	180 USD	94.69%	150'085.87	0.02	a)
US22822VAQ41	4.1500 % CCI 4.15 07/01/50	0	200	160	40 USD	79.44%	27'979.55	0.00	a)
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	0	400	130	270 USD	81.54%	193'858.46	0.02	a)
US22822VAU52	3.2500 % CCI 3 1/4 01/15/51	0	410	310	100 USD	67.93%	59'816.20	0.01	a)
US22822VAV36	1.0500 % CCI 1.05 07/15/26	0	330	230	100 USD	90.38%	79'579.71	0.01	a)
US22822VAW19	2.1000 % CCI 2.1 04/01/31	0	610	410	200 USD	80.36%	141'513.54	0.02	a)
US22822VAX91	2.9000 % CCI 2.9 04/01/41	0	330	230	100 USD	69.29%	61'016.13	0.01	a)
US23311VAJ61	5.6250 % DCP 5 5/8 07/15/27	0	288	0	288 USD	100.50%	254'866.39	0.03	a)
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US253393AF94	3.1500 % DKS 3.15 01/15/32	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US253393AG77	4.1000 % DKS 4.1 01/15/52	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US254709AK45	3.9500 % DFS 3.95 11/06/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US254709AM01	4.1000 % DFS 4.1 02/09/27	320	0	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US254709AP32	4.5000 % DFS 4 1/2 01/30/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DBG34	5.3000 % WBD 5.3 05/15/49	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DBH17	4.6500 % WBD 4.65 05/15/50	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25470DBL29	4.0000 % WBD 4 09/15/55	100	700	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US256677AD70	4.1500 % DG 4.15 11/01/25	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US256677AF29	4.1250 % DG 4 1/8 05/01/28	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25746UDL08	2.2500 % D 2 1/4 08/15/31 C	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26078JAC45	4.4930 % DD 4.493 11/15/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26078JAD28	4.7250 % DD 4.725 11/15/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26078JAF75	5.4190 % DD 5.419 11/15/48	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26441CAS44	2.6500 % DUK 2.65 09/01/26	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26884LAF67	3.9000 % EQT 3.9 10/01/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26884LAG41	7.0000 % EQT 7 02/01/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US26884LAH24	6.1250 % EQT 6 1/8 02/01/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US292480AJ92	5.0000 % ET 5 05/15/44	0	360	0	360 USD	87.21%	276'462.83	0.03	a)
US292480AK65	4.4000 % ET 4.4 03/15/27	0	504	0	504 USD	97.52%	432'808.78	0.05	a)
US29273RAP47	6.0500 % ET 6.05 06/01/41	450	0	0	450 USD	99.14%	392'836.21	0.04	a)
US29273RAR03	6.5000 % ET 6 1/2 02/01/42	150	0	0	150 USD	104.45%	137'964.53	0.02	a)
US29273RBE80	4.9000 % ET 4.9 03/15/35	450	50	0	500 USD	92.80%	408'591.93	0.05	a)
US29273RBL24	5.3000 % ET 5.3 04/15/47	150	50	0	200 USD	89.29%	157'241.40	0.02	a)
US29278NAH61	4.5000 % ET 4 1/2 04/15/24	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278NAQ60	3.7500 % ET 3 3/4 05/15/30	410	90	0	500 USD	91.16%	401'339.28	0.05	a)
US29279FAA75	6.2500 % ET 6 1/4 04/15/49	610	40	0	650 USD	101.80%	582'665.09	0.07	a)
US29359UAB52	4.9500 % ESGR 4.95 06/01/29	0	200	0	200 USD	97.12%	171'041.38	0.02	a)
US29670GAD43	2.7040 % WTRG 2.704 04/15/30	0	160	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29670GAG73	5.3000 % WTRG 5.3 05/01/52	0	160	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US299808AH86	3.5000 % RE 3 1/2 10/15/50	0	306	0	306 USD	71.16%	191'737.79	0.02	a)
US299808AJ43	3.1250 % RE 3 1/8 10/15/52	0	144	0	144 USD	63.53%	80'550.72	0.01	a)
US30212PAR64	3.2500 % EXPE 3 1/4 02/15/30	400	50	0	450 USD	89.11%	353'078.71	0.04	a)
US30303M8G02	3.5000 % META 3 1/2 08/15/27	0	554	0	554 USD	95.82%	467'457.53	0.05	a)
US30303M8H84	3.8500 % META 3.85 08/15/32	0	490	0	490 USD	92.63%	399'679.69	0.05	a)
US30303M8J41	4.4500 % META 4.45 08/15/52	0	576	0	576 USD	87.40%	443'278.34	0.05	a)
US30303M8K14	4.6500 % META 4.65 08/15/62	0	269	0	269 USD	88.47%	209'565.13	0.02	a)
US30303M8L96	4.6000 % META 4.6 05/15/28	0	275	0	275 USD	99.51%	240'969.80	0.03	a)
US30303M8M79	4.8000 % META 4.8 05/15/30	0	144	0	144 USD	99.94%	126'726.55	0.01	a)
US30303M8N52	4.9500 % META 4.95 05/15/33	0	306	0	306 USD	99.93%	269'263.19	0.03	a)
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	0	490	0	490 USD	103.64%	447'186.21	0.05	a)
US30303M8R66	5.7500 % META 5 3/4 05/15/63	0	288	0	288 USD	104.75%	265'636.97	0.03	a)
US35137LAM72	3.0500 % FOXA 3.05 04/07/25	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36186CBY84	8.0000 % ALLY 8 11/01/31	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US373334JW27	4.3000 % SO 4.3 03/15/42	200	50	0	250 USD	85.66%	188'565.82	0.02	a)
US38141GWV21	3.8140 % GS 3.814 04/23/29	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US403949AB64	5.8750 % DINO 5 7/8 04/01/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404119BN87	5.0000 % HCA 5 03/15/24	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404119BT57	5.2500 % HCA 5 1/4 06/15/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404119BU21	4.5000 % HCA 4 1/2 02/15/27	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280CJ69	1.6450 % HSBC 1.645 04/18/26	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US416515BE33	2.8000 % HIG 2.8 08/19/29	0	306	0	306 USD	89.42%	240'935.82	0.03	a)
US416515BF08	3.6000 % HIG 3.6 08/19/49	0	306	0	306 USD	75.57%	203'632.86	0.02	a)
US416518AD08	2.9000 % HIG 2.9 09/15/51	0	108	0	108 USD	64.02%	60'880.54	0.01	a)
US42225UAG94	3.1000 % HR 3.1 02/15/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US42225UAH77	2.0000 % HR 2 03/15/31	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US423452AG66	2.9000 % HP 2.9 09/29/31	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US438516BL94	2.5000 % HON 2 1/2 11/01/26	370	0	0	370 USD	94.26%	307'108.90	0.03	a)
US438516BZ80	1.9500 % HON 1.95 06/01/30	410	90	0	500 USD	84.52%	372'117.79	0.04	a)
US454889AV81	5.6250 % AEP 5 5/8 04/01/53	0	184	0	184 USD	100.45%	162'751.26	0.02	a)
US457187AB87	3.2000 % INGR 3.2 10/01/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140AY68	4.1000 % INTC 4.1 05/11/47	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45866FAD69	3.7500 % ICE 3 3/4 12/01/25	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45866FAK03	2.1000 % ICE 2.1 06/15/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US45866FAQ72	3.0000 % ICE 3 09/15/60	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KC42	4.2500 % IBM 4 1/4 05/15/49	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46590XAT37	3.6250 % JBS5BZ 3 5/8 01/15/32 144A	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46590XAU00	3.6250 % JBS5BZ 3 5/8 01/15/32	0	500	0	500 USD	83.88%	369'280.66	0.04	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDF09	4.5650 % JPM 4.565 06/14/30	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47215PAE60	3.3750 % JD 3 3/8 01/14/30	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47233JBH05	4.1500 % JEF 4.15 01/23/30	485	65	0	550 USD	93.06%	450'714.67	0.05	a)
US491771AJ16	4.9000 % KVUE 4.9 03/22/33 144A	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50155QAL41	3.1500 % KD 3.15 10/15/31	0	306	0	306 USD	82.33%	221'838.94	0.03	a)
US50540RAS13	4.7000 % LH 4.7 02/01/45	0	184	0	184 USD	89.48%	144'975.60	0.02	a)
US50540RAU68	3.6000 % LH 3.6 09/01/27	0	360	0	360 USD	95.12%	301'524.06	0.03	a)
US55261FAR55	5.0530 % MTB 5.053 01/27/34	0	250	0	250 USD	91.72%	201'912.32	0.02	a)
US55279HAK68	2.9000 % MTB 2.9 02/06/25 BKNT	0	250	0	250 USD	97.25%	214'084.82	0.02	a)
US55279HAQ39	3.4000 % MTB 3.4 08/17/27 BKNT	0	250	0	250 USD	91.32%	201'021.86	0.02	a)
US55903VAC72	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24 144A	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAG86	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27 144A	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAL71	4.2790 % WBD 4.279 03/15/32 144A	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAQ68	5.1410 % WBD 5.141 03/15/52 144A	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAS25	5.3910 % WBD 5.391 03/15/62 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VAW37	3.4280 % WBD 3.428 03/15/24	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VBA08	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VBC63	4.2790 % WBD 4.279 03/15/32	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VBE20	5.1410 % WBD 5.141 03/15/52	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55903VBF94	5.3910 % WBD 5.391 03/15/62	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BE27	4.6250 % MAR 4 5/8 06/15/30 FF	0	288	0	288 USD	96.52%	244'778.25	0.03	a)
US571903BF91	3.5000 % MAR 3 1/2 10/15/32 GG	0	306	0	306 USD	87.26%	235'132.71	0.03	a)
US571903BG74	2.8500 % MAR 2.85 04/15/31 HH	0	288	0	288 USD	85.38%	216'521.30	0.02	a)
US571903BH57	2.7500 % MAR 2 3/4 10/15/33 II	0	122	0	122 USD	80.61%	86'592.90	0.01	a)
US571903BN26	5.5500 % MAR 5.55 10/15/28	0	144	0	144 USD	101.62%	128'852.71	0.01	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	0	350	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595620AT22	3.6500 % BRKHEC 3.65 04/15/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595620AU94	4.2500 % BRKHEC 4 1/4 07/15/49	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59562VAM90	6.1250 % BRKHEC 6 1/8 04/01/36	0	30	0	30 USD	105.38%	27'838.00	0.00	a)
US59562VAP22	5.9500 % BRKHEC 5.95 05/15/37	370	35	0	405 USD	103.73%	369'911.59	0.04	a)
US59562VBD82	5.1500 % BRKHEC 5.15 11/15/43	0	45	0	45 USD	95.45%	37'823.01	0.00	a)
US606822AD62	3.8500 % MUFG 3.85 03/01/26	600	500	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822AR58	3.2870 % MUFG 3.287 07/25/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BH67	3.7410 % MUFG 3.741 03/07/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BK96	3.7510 % MUFG 3.751 07/18/39	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BM52	3.1950 % MUFG 3.195 07/18/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BN36	2.1930 % MUFG 2.193 02/25/25	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BS23	1.4120 % MUFG 1.412 07/17/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US606822BU78	2.0480 % MUFG 2.048 07/17/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YAG44	2.8390 % MIZUHO 2.839 09/13/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YAK55	3.6630 % MIZUHO 3.663 02/28/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YAM12	3.1700 % MIZUHO 3.17 09/11/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YAR09	4.0180 % MIZUHO 4.018 03/05/28	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YBE86	2.5910 % MIZUHO 2.591 05/25/31	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YBH18	2.2010 % MIZUHO 2.201 07/10/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YBL20	1.9790 % MIZUHO 1.979 09/08/31	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US615369AM79	3.2500 % MCO 3 1/4 01/15/28	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61747YED31	2.2390 % MS 2.239 07/21/32 GMTN	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61761JVL06	3.7000 % MS 3.7 10/23/24 GMTN	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US628530BC02	5.4000 % VTRS 5.4 11/29/43	0	252	0	252 USD	87.31%	193'741.89	0.02	a)
US628530BK28	4.5500 % VTRS 4.55 04/15/28	0	245	0	245 USD	96.25%	207'643.40	0.02	a)
US62854AAN46	3.9500 % VTRS 3.95 06/15/26	0	654	0	654 USD	96.56%	556'040.64	0.06	a)
US62854AAP93	5.2500 % VTRS 5 1/4 06/15/46	0	306	0	306 USD	81.45%	219'465.37	0.02	a)
US63253QAE44	4.9000 % NAB 4.9 06/13/28	0	250	0	250 USD	99.82%	219'733.99	0.02	a)
US63254AAP30	3.3750 % NAB 3 3/8 01/14/26	0	500	0	500 USD	97.04%	427'249.46	0.05	a)
US63254ABE73	3.9050 % NAB 3.905 06/09/27	0	250	0	250 USD	96.86%	213'214.18	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US65334HAE27	5.8750 % CNOOC 5 7/8 03/10/35	0	250	0	250 USD	105.94%	233'208.82	0.03	a)
US65334HAG74	6.4000 % CNOOC 6.4 05/15/37	0	800	0	800 USD	111.17%	783'154.83	0.09	a)
US65334HAJ14	7.5000 % CNOOC 7 1/2 07/30/39	0	70	0	70 USD	122.08%	75'249.70	0.01	a)
US655844BH01	4.8370 % NSC 4.837 10/01/41	490	110	0	600 USD	92.80%	490'293.94	0.06	a)
US655844BS65	2.9000 % NSC 2.9 06/15/26	200	50	0	250 USD	95.32%	209'830.44	0.02	a)
US66989HAP38	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 02/14/25	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US680223AK06	3.8750 % ORI 3 7/8 08/26/26	0	200	0	200 USD	96.41%	169'785.01	0.02	a)
US68389XAE58	6.5000 % ORCL 6 1/2 04/15/38	200	60	0	260 USD	106.57%	243'987.99	0.03	a)
US68389XAH89	6.1250 % ORCL 6 1/8 07/08/39	250	0	150	100 USD	102.41%	90'172.99	0.01	a)
US68389XAM74	5.3750 % ORCL 5 3/8 07/15/40	495	100	0	595 USD	95.36%	499'601.31	0.06	a)
US68389XAU90	3.4000 % ORCL 3.4 07/08/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US68389XAV73	4.3000 % ORCL 4.3 07/08/34	600	0	450	150 USD	90.59%	119'655.12	0.01	a)
US68389XAW56	4.5000 % ORCL 4 1/2 07/08/44	400	0	300	100 USD	83.80%	73'789.74	0.01	a)
US68389XBC83	2.9500 % ORCL 2.95 05/15/25	550	100	400	250 USD	96.99%	213'505.20	0.02	a)
US68389XBD66	3.2500 % ORCL 3 1/4 05/15/30	100	0	0	100 USD	89.48%	78'794.96	0.01	a)
US68389XBE40	3.9000 % ORCL 3.9 05/15/35	150	0	0	150 USD	85.87%	113'423.34	0.01	a)
US68389XBF15	4.1250 % ORCL 4 1/8 05/15/45	250	0	0	250 USD	79.11%	174'156.94	0.02	a)
US68389XBG97	4.3750 % ORCL 4 3/8 05/15/55	400	100	100	400 USD	78.23%	275'547.34	0.03	a)
US68389XBH70	3.8500 % ORCL 3.85 07/15/36	550	0	450	100 USD	84.01%	73'974.30	0.01	a)
US68389XBJ37	4.0000 % ORCL 4 07/15/46	450	100	300	250 USD	76.95%	169'395.81	0.02	a)
US68389XBM65	2.6500 % ORCL 2.65 07/15/26	900	100	450	550 USD	94.17%	456'059.92	0.05	a)
US68389XBN49	3.2500 % ORCL 3 1/4 11/15/27	600	43	0	643 USD	93.65%	530'229.59	0.06	a)
US68389XBQ79	4.0000 % ORCL 4 11/15/47	300	0	0	300 USD	76.21%	201'329.92	0.02	a)
US68389XBS36	2.9500 % ORCL 2.95 11/15/24	400	50	400	50 USD	98.15%	43'211.23	0.00	a)
US68389XBT19	2.5000 % ORCL 2 1/2 04/01/25	450	0	150	300 USD	96.83%	255'803.39	0.03	a)
US68389XBV64	2.9500 % ORCL 2.95 04/01/30	800	51	450	401 USD	88.17%	311'342.88	0.04	a)
US68389XBW48	3.6000 % ORCL 3.6 04/01/40	0	400	0	400 USD	77.45%	272'810.94	0.03	a)
US68389XBX21	3.6000 % ORCL 3.6 04/01/50	600	100	300	400 USD	70.21%	247'304.93	0.03	a)
US68389XBY04	3.8500 % ORCL 3.85 04/01/60	550	100	300	350 USD	69.18%	213'219.59	0.02	a)
US68389XCA19	3.9500 % ORCL 3.95 03/25/51	800	0	300	500 USD	74.66%	328'703.15	0.04	a)
US68389XCB91	4.1000 % ORCL 4.1 03/25/61	150	0	0	150 USD	73.02%	96'442.02	0.01	a)
US68389XCE31	2.8750 % ORCL 2 7/8 03/25/31	500	51	0	551 USD	86.31%	418'773.62	0.05	a)
US718172AC39	6.3750 % PM 6 3/8 05/16/38	570	0	0	570 USD	107.79%	541'012.56	0.06	a)
US718172AM11	4.3750 % PM 4 3/8 11/15/41	240	60	0	300 USD	84.93%	224'348.47	0.03	a)
US718172AP42	4.5000 % PM 4 1/2 03/20/42	100	0	0	100 USD	86.26%	75'954.13	0.01	a)
US718172AU37	3.8750 % PM 3 7/8 08/21/42	0	110	0	110 USD	78.82%	76'348.26	0.01	a)
US718172CB38	3.1250 % PM 3 1/8 08/17/27	400	190	0	590 USD	93.97%	488'213.80	0.06	a)
US741503BC97	3.5500 % BKNG 3.55 03/15/28	0	360	0	360 USD	95.12%	301'523.43	0.03	a)
US743315AR46	2.4500 % PGR 2.45 01/15/27	0	2'157	940	1'217 USD	93.30%	999'783.03	0.11	a)
US743315AZ61	3.0000 % PGR 3 03/15/32	0	123	0	123 USD	86.78%	93'993.17	0.01	a)
US743315BA02	3.7000 % PGR 3.7 03/15/52	0	288	0	288 USD	77.88%	197'491.28	0.02	a)
US745867AX94	5.0000 % PHM 5 01/15/27	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LAZ31	3.4500 % DGX 3.45 06/01/26	0	306	0	306 USD	96.31%	259'499.46	0.03	a)
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	0	360	0	360 USD	85.56%	271'220.64	0.03	a)
US75513ECA73	4.8750 % RTX 4 7/8 10/15/40	100	0	0	100 USD	92.57%	81'515.33	0.01	a)
US75524KNH31	2.2500 % CFG 2 1/4 04/28/25 BKNT	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US7591EPAQ39	2.2500 % RF 2 1/4 05/18/25	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US761713BG06	4.4500 % BATSLN 4.45 06/12/25	1'056	0	0	1'056 USD	98.46%	915'539.09	0.10	a)
US775109CJ87	4.5000 % RCICN 4 1/2 03/15/42	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US776743AD85	3.8000 % ROP 3.8 12/15/26	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US776743AF34	4.2000 % ROP 4.2 09/15/28	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78486QAE17	3.1250 % SIVB 3 1/8 06/05/30	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78486QAF81	1.8000 % SIVB 1.8 02/02/31	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAF13	3.7000 % CRM 3.7 04/11/28	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBC99	2.4900 % SANUSA 2.49 01/06/28	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513AU91	3.2000 % SCHW 3.2 01/25/28	0	100	0	100 USD	93.77%	82'565.92	0.01	a)
US808513BB02	4.2000 % SCHW 4.2 03/24/25	0	410	310	100 USD	98.81%	87'003.09	0.01	a)
US808513BF16	0.9000 % SCHW 0.9 03/11/26	0	450	110	340 USD	91.71%	274'569.61	0.03	a)
US808513BP97	2.0000 % SCHW 2 03/20/28	0	500	310	190 USD	88.23%	147'619.12	0.02	a)
US808513BS37	2.3000 % SCHW 2.3 05/13/31	0	410	0	410 USD	83.00%	299'635.28	0.03	a)
US808513BW49	3.3000 % SCHW 3.3 04/01/27	0	490	330	160 USD	94.50%	133'134.93	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US808513BY05	2.4500 % SCHW 2.45 03/03/27	0	500	310	190 USD	92.23%	154'304.61	0.02	a)
US808513CA10	2.9000 % SCHW 2.9 03/03/32	0	530	90	440 USD	84.51%	327'416.00	0.04	a)
US82481LAC37	2.8750 % TACHEM 2 7/8 09/23/23	396	0	396	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	0	178	0	178 USD	81.71%	128'069.75	0.01	a)
US842587CV72	3.2500 % SO 3 1/4 07/01/26	450	100	0	550 USD	95.54%	462'693.41	0.05	a)
US842587CW55	4.2500 % SO 4 1/4 07/01/36	560	140	0	700 USD	88.79%	547'284.54	0.06	a)
US843646AH38	5.1500 % SO 5.15 09/15/41	200	50	0	250 USD	92.10%	202'747.52	0.02	a)
US843646AM23	4.1500 % SO 4.15 12/01/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US852060AT99	8.7500 % S 8 3/4 03/15/32	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US858119BM10	3.2500 % STLD 3 1/4 01/15/31	410	0	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US865622BN30	3.4000 % SUMIBK 3.4 07/11/24 GMTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAC47	3.7840 % SUMIBK 3.784 03/09/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAF77	2.6320 % SUMIBK 2.632 07/14/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAK62	3.0100 % SUMIBK 3.01 10/19/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAN02	3.4460 % SUMIBK 3.446 01/11/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAR16	3.3640 % SUMIBK 3.364 07/12/27	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAV28	3.3520 % SUMIBK 3.352 10/18/27	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBC38	3.9440 % SUMIBK 3.944 07/19/28	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBG42	4.3060 % SUMIBK 4.306 10/16/28	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBP41	3.0400 % SUMIBK 3.04 07/16/29	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBV19	2.3480 % SUMIBK 2.348 01/15/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBW91	2.7500 % SUMIBK 2 3/4 01/15/30	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCB46	2.1300 % SUMIBK 2.13 07/08/30	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MCE84	1.7100 % SUMIBK 1.71 01/12/31	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86787EBB20	4.0500 % TFC 4.05 11/03/25 BKNT	815	185	0	1'000 USD	97.71%	860'409.18	0.10	a)
US86787EBC03	3.2000 % TFC 3.2 04/01/24 BNKT	815	0	815	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US867914BS12	4.0000 % TFC 4 05/01/25	400	100	0	500 USD	98.18%	432'247.03	0.05	a)
US87165BAL71	3.7000 % SYF 3.7 08/04/26	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87165BAM54	3.9500 % SYF 3.95 12/01/27	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87165BAR42	2.8750 % SYF 2 7/8 10/28/31	0	330	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264AAV70	4.7500 % TMUS 4 3/4 02/01/28	0	360	0	360 USD	98.25%	311'450.54	0.04	a)
US87264AAX37	4.3750 % TMUS 4 3/8 04/15/40	0	360	0	360 USD	87.76%	278'212.66	0.03	a)
US87264AAZ84	4.5000 % TMUS 4 1/2 04/15/50	0	587	0	587 USD	84.82%	438'429.34	0.05	a)
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	0	1'228	0	1'228 USD	96.11%	1'039'205.74	0.12	a)
US87264ABF12	3.8750 % TMUS 3 7/8 04/15/30	0	1'410	0	1'410 USD	92.90%	1'153'365.29	0.13	a)
US87264ABL89	3.0000 % TMUS 3 02/15/41	0	180	0	180 USD	72.46%	114'852.81	0.01	a)
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	0	562	0	562 USD	69.02%	341'574.49	0.04	a)
US87264ABV61	3.3750 % TMUS 3 3/8 04/15/29	0	526	0	526 USD	91.90%	425'662.77	0.05	a)
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	0	642	0	642 USD	89.62%	506'648.86	0.06	a)
US87264ABX28	2.2500 % TMUS 2 1/4 11/15/31	0	360	0	360 USD	81.13%	257'182.38	0.03	a)
US87264ABY01	3.6000 % TMUS 3.6 11/15/60	0	1'132	830	302 USD	69.45%	184'672.64	0.02	a)
US87264ACA16	2.0500 % TMUS 2.05 02/15/28	0	368	0	368 USD	89.16%	288'930.13	0.03	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	0	360	0	360 USD	84.42%	267'624.29	0.03	a)
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	0	360	0	360 USD	83.41%	264'396.30	0.03	a)
US87264ACT07	3.4000 % TMUS 3.4 10/15/52	0	642	350	292 USD	69.46%	178'597.77	0.02	a)
US87264ACW36	5.6500 % TMUS 5.65 01/15/53	0	306	130	176 USD	100.05%	155'051.66	0.02	a)
US87264ACY91	5.0500 % TMUS 5.05 07/15/33	0	459	0	459 USD	98.17%	396'789.84	0.04	a)
US87264ACZ66	4.9500 % TMUS 4.95 03/15/28	0	306	0	306 USD	99.43%	267'900.05	0.03	a)
US87264ADA07	4.8000 % TMUS 4.8 07/15/28	0	180	0	180 USD	98.79%	156'588.61	0.02	a)
US87264ADB89	5.7500 % TMUS 5 3/4 01/15/54	0	180	0	180 USD	101.32%	160'596.58	0.02	a)
US87264ADC62	5.7500 % TMUS 5 3/4 01/15/34	0	216	0	216 USD	103.30%	196'472.89	0.02	a)
US87264ADD46	6.0000 % TMUS 6 06/15/54	0	153	0	153 USD	105.33%	141'901.31	0.02	a)
US87612BBL53	6.5000 % TRGP 6 1/2 07/15/27	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612BBQ41	5.5000 % TRGP 5 1/2 03/01/30	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612BBS07	4.8750 % TRGP 4 7/8 02/01/31	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612BBU52	4.0000 % TRGP 4 01/15/32	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612GAB77	4.9500 % TRGP 4.95 04/15/52	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88034PAB58	2.0000 % TME 2 09/03/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JAJ79	6.5500 % TWC 6.55 05/01/37	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JAY47	5.8750 % TWC 5 7/8 11/15/40	490	0	490	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US88732JBB35	5.5000 % TWC 5 1/2 09/01/41	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US88732JBD90	4.5000 % TWC 4 1/2 09/15/42	510	0	510	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US891906AC37	4.8000 % GPN 4.8 04/01/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89417EAD13	6.2500 % TRV 6 1/4 06/15/37 MTN	0	92	0	92 USD	110.08%	89'176.87	0.01	a)
US89417EAJ82	4.6000 % TRV 4.6 08/01/43	0	367	0	367 USD	92.77%	299'781.73	0.03	a)
US89417EAN94	4.0500 % TRV 4.05 03/07/48	0	288	0	288 USD	83.20%	210'988.04	0.02	a)
US89417EAP43	4.1000 % TRV 4.1 03/04/49	0	306	0	306 USD	84.35%	227'285.84	0.03	a)
US89417EAS81	5.4500 % TRV 5.45 05/25/53	0	144	0	144 USD	101.79%	129'068.02	0.01	a)
US89420GAE98	6.3750 % TRV 6 3/8 03/15/33	0	144	0	144 USD	111.03%	140'784.52	0.02	a)
US89641UAC53	4.4000 % WTW 4.4 03/15/26	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US911312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHK95	3.6000 % USB 3.6 09/11/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHM51	3.1000 % USB 3.1 04/27/26 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHR49	3.1500 % USB 3.15 04/27/27 X	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHS22	3.9000 % USB 3.9 04/26/28 MTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHX17	2.4000 % USB 2.4 07/30/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HHZ64	1.4500 % USB 1.45 05/12/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HJA95	1.3750 % USB 1 3/8 07/22/30 MTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91159HJD35	2.6770 % USB 2.677 01/27/33 MTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US913017BT50	4.5000 % RTX 4 1/2 06/01/42	285	65	0	350 USD	87.69%	270'248.46	0.03	a)
US913017CR85	3.1250 % RTX 3 1/8 05/04/27	1'220	0	0	1'220 USD	94.25%	1'012'514.38	0.11	a)
US913017CX53	4.6250 % RTX 4 5/8 11/16/48	400	100	0	500 USD	87.52%	385'311.07	0.04	a)
US913017CY37	4.1250 % RTX 4 1/8 11/16/28	0	190	0	190 USD	95.94%	160'519.97	0.02	a)
US91324PCP53	3.7500 % UNH 3 3/4 07/15/25	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91911TAH68	6.8750 % VALEBZ 6 7/8 11/21/36	240	73	0	313 USD	106.50%	293'526.94	0.03	a)
US91911TAK97	6.8750 % VALEBZ 6 7/8 11/10/39	140	0	0	140 USD	106.75%	131'598.20	0.01	a)
US91911TAP84	6.2500 % VALEBZ 6 1/4 08/10/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91911TAQ67	3.7500 % VALEBZ 3 3/4 07/08/30	200	0	0	200 USD	89.61%	157'818.86	0.02	a)
US92343VGG32	1.4500 % VZ 1.45 03/20/26	0	550	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGJ70	2.5500 % VZ 2.55 03/21/31	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAD82	2.7000 % VTRS 2.7 06/22/30	0	305	0	305 USD	84.01%	225'635.86	0.03	a)
US92556VAE65	3.8500 % VTRS 3.85 06/22/40	0	264	0	264 USD	74.12%	172'299.02	0.02	a)
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	0	330	0	330 USD	68.19%	198'154.50	0.02	a)
US925650AA17	4.3750 % VICI 4 3/8 05/15/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US925650AB99	4.7500 % VICI 4 3/4 02/15/28	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US925650AD55	5.1250 % VICI 5 1/8 05/15/32	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US925650AE39	5.6250 % VICI 5 5/8 05/15/52	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US928881AF82	2.9500 % VNT 2.95 04/01/31	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92936UAG40	2.4000 % WPC 2.4 02/01/31	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US929903AM44	5.5000 % WFC 5 1/2 08/01/35	0	194	0	194 USD	98.13%	167'638.91	0.02	a)
US948596AD39	3.5000 % WB 3 1/2 07/05/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US948596AE12	3.3750 % WB 3 3/8 07/08/30	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949746RF01	5.6060 % WFC 5.606 01/15/44	0	360	100	260 USD	97.48%	223'164.25	0.03	a)
US949746RW34	3.0000 % WFC 3 04/22/26	0	1'300	0	1'300 USD	95.17%	1'089'405.81	0.12	a)
US949746SH57	3.0000 % WFC 3 10/23/26	0	1'248	0	1'248 USD	94.53%	1'038'854.69	0.12	a)
US949746FP04	5.3750 % WFC 5 3/8 11/02/43	0	459	260	199 USD	95.58%	167'492.54	0.02	a)
US949746FY11	4.1000 % WFC 4.1 06/03/26 MTN	0	540	0	540 USD	97.33%	462'793.15	0.05	a)
US949746GK08	3.9000 % WFC 3.9 05/01/45	0	367	0	367 USD	79.89%	258'158.49	0.03	a)
US949746GL80	4.3000 % WFC 4.3 07/22/27 GMTN	0	498	0	498 USD	97.07%	425'660.62	0.05	a)
US949746GQ77	4.9000 % WFC 4.9 11/17/45 GMTN	0	288	0	288 USD	88.45%	224'300.69	0.03	a)
US949746GT17	4.4000 % WFC 4.4 06/14/46 MTN	0	153	0	153 USD	82.31%	110'888.35	0.01	a)
US949746GU89	4.7500 % WFC 4 3/4 12/07/46 MTN	0	360	150	210 USD	86.92%	160'726.33	0.02	a)
US95000U2A01	3.5840 % WFC 3.584 05/22/28 MTN	0	540	0	540 USD	94.73%	450'440.21	0.05	a)
US95000U2D40	4.1500 % WFC 4.15 01/24/29 MTN	0	957	0	957 USD	95.95%	808'541.54	0.09	a)
US95000U2G70	2.8790 % WFC 2.879 10/30/30 MTN	0	360	0	360 USD	87.84%	278'449.78	0.03	a)
US95000U2J10	2.5720 % WFC 2.572 02/11/31 MTN	0	650	0	650 USD	85.46%	489'124.13	0.06	a)
US95000U2K82	2.1640 % WFC 2.164 02/11/26 MTN	0	860	500	360 USD	96.79%	306'811.59	0.03	a)
US95000U2L65	4.4780 % WFC 4.478 04/04/31 MTN	0	950	0	950 USD	94.98%	794'513.18	0.09	a)
US95000U2M49	5.0130 % WFC 5.013 04/04/51 MTN	0	980	400	580 USD	92.96%	474'775.11	0.05	a)
US95000U2N22	2.1880 % WFC 2.188 04/30/26	0	1'271	0	1'271 USD	95.80%	1'072'181.37	0.12	a)
US95000U2Q52	3.0680 % WFC 3.068 04/30/41	0	855	200	655 USD	74.04%	427'040.21	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US95000U2S19	2.3930 % WFC 2.393 06/02/28 MTN	0	360	0	360 USD	91.19%	289'077.45	0.03	a)
US95000U2U64	3.3500 % WFC 3.35 03/02/33 MTN	0	360	0	360 USD	85.60%	271'348.70	0.03	a)
US95000U2V48	3.5260 % WFC 3.526 03/24/28 MTN	0	674	0	674 USD	94.83%	562'797.74	0.06	a)
US95000U2Z51	4.6110 % WFC 4.611 04/25/53 MTN	0	774	400	374 USD	87.60%	288'474.17	0.03	a)
US95000U3A91	4.8080 % WFC 4.808 07/25/28 MTN	0	360	0	360 USD	98.21%	311'327.22	0.04	a)
US95000U3B74	4.8970 % WFC 4.897 07/25/33 MTN	0	660	0	660 USD	95.27%	553'650.16	0.06	a)
US95000U3D31	5.3890 % WFC 5.389 04/24/34	0	670	0	670 USD	98.55%	581'390.95	0.07	a)
US95000U3E14	5.5740 % WFC 5.574 07/25/29 MTN	0	800	0	800 USD	100.83%	710'306.58	0.08	a)
US95000U3F88	5.5570 % WFC 5.557 07/25/34 MTN	0	800	360	440 USD	99.78%	386'586.14	0.04	a)
US95000U3G61	6.3030 % WFC 6.303 10/23/29	0	522	0	522 USD	103.81%	477'179.88	0.05	a)
US95000U3H45	6.4910 % WFC 6.491 10/23/34	0	614	0	614 USD	106.49%	575'771.25	0.07	a)
US962166BY91	4.0000 % WY 4 04/15/30	400	0	0	400 USD	93.39%	328'930.16	0.04	a)
US970648AG61	4.5000 % WTW 4 1/2 09/15/28	0	160	160	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US970648AJ01	2.9500 % WTW 2.95 09/15/29	0	410	410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98956PAS11	3.0500 % ZBH 3.05 01/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1488480333	3.6350 % EMAAR 3.635 09/15/26 EMTN	0	300	0	300 USD	95.63%	252'607.78	0.03	a)
XS1713193586	3.9750 % VNKRL 3.975 11/09/27 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1958532829	4.2000 % VNKRL 4.2 06/07/24 EMTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1964701822	5.3750 % ARNDT 5 3/8 03/21/29 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1980825464	3.5600 % MARUB 3.56 04/26/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2168040744	4.0000 % BNKEA 4 05/29/30 EMTN	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2179918037	2.0000 % CNPCC 2 06/23/30	0	200	0	200 USD	85.30%	150'216.55	0.02	a)
XS2193950354	2.1250 % CHINLP 2 1/8 06/30/30 EMTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2201858938	1.2000 % ICBCAS 1.2 07/20/25 GMTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2226703655	1.3190 % MARUB 1.319 09/18/25	200	0	0	200 USD	93.74%	165'076.71	0.02	a)
XS2236363227	2.5000 % HONHAI 2 1/2 10/28/30 EMTN	0	200	0	200 USD	84.00%	147'937.68	0.02	a)
XS2243948457	2.2500 % BCHINA 2 1/4 10/22/30 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2289592607	2.0000 % CICCHK 2 01/26/26 EMTN	0	300	0	300 USD	94.20%	248'830.22	0.03	a)
XS2449907463	2.5910 % FABUH 2.591 03/02/27	0	300	0	300 USD	93.25%	246'333.86	0.03	a)
XS2493296813	5.5000 % BSFR 5 1/2 11/23/27 EMTN	0	200	0	200 USD	100.98%	177'835.88	0.02	a)
XS2539374673	5.1250 % FABUH 5 1/8 10/13/27 EMTN	0	200	0	200 USD	100.34%	176'705.25	0.02	a)
XS2585576973	5.4930 % CICCHK 5.493 03/01/26 EMTN	0	300	0	300 USD	100.44%	265'335.25	0.03	a)
USD							91'274'741.50	10.30	

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

753'683'121.40 85.09

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

753'683'121.40 85.09

CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	236'929	239'745	15'493	461'181 CHF	101.93	47'006'846.64	5.31	a)
--------------	---	---------	---------	--------	-------------	--------	---------------	------	----

CHF 47'006'846.64 5.31

CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	1'410'347	1'057'526	399'852	2'068'021 EUR	118.99	234'479'883.14	26.47	a)
--------------	--	-----------	-----------	---------	---------------	--------	----------------	-------	----

EUR 234'479'883.14 26.47

CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	2'928'076	1'967'381	725'547	4'169'910 USD	128.60	472'196'391.62	53.31	a)
--------------	--	-----------	-----------	---------	---------------	--------	----------------	-------	----

USD 472'196'391.62 53.31

Derivative Finanzinstrumente

7'243.02 0.00

Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 03.03.2023	418'112'150	452'639'000		CHF/USD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.03.2023	194'565'055	194'155'000		CHF/EUR		0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.03.2023	23'679'764	20'791'000		CHF/GBP		0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 03.03.2023	1'073'815	150'939'000		CHF/JPY		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.03.2023	872'574	875'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.03.2023	1'938'644	2'127'000		CHF/USD		0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.03.2023	871'818	877'000		CHF/EUR		0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.03.2023	1'124'950	1'240'000		CHF/USD		0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.03.2023	195'860'000	194'910'667		EUR/CHF		0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 03.03.2023	455'806'000	427'408'830		USD/CHF		0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 03.03.2023	20'791'000	23'566'515		GBP/CHF		0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 03.03.2023		150'939'000	1'035'864		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.04.2023		192'576'914	193'839'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2023		412'115'086	441'104'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.04.2023		23'442'597	20'745'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.04.2023		3'667'456	533'876'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2023		1'079'000	1'080'009		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2023		120'000	134'961		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2023		4'541'000	4'250'317		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.04.2023		25'213	3'650'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2023		436'563'000	398'749'223		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2023		20'625'000	23'296'886		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2023		537'526'000	3'690'094		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2023		192'760'000	191'320'083		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		397'516'579	436'592'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		23'079'016	20'484'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		188'369'118	190'076'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		4'596'426	5'052'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		2'418'586	2'143'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		493'127	497'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		201'727	203'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		1'290'219	1'139'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		535'961	481'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		2'496'063	2'537'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		7'159'113	7'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		784'283	702'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		1'981'622	2'227'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		798'222	812'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.05.2023		451'750'000	404'706'562		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.05.2023		24'949'000	27'831'682		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		194'040'000	191'034'514		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		3'691'907	537'175'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		246'710	35'730'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		235'581	34'188'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		68'059	10'150'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		127'359	19'072'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		405'844'337	454'698'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		4'181'094	633'382'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		27'793'341	24'989'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		191'216'140	194'584'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		3'223'858	3'289'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		5'897'439	6'618'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		1'082'347	1'111'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		1'620'101	1'827'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		143'912	21'738'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		81'000	90'685		GBP/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		380'243	340'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		6'668'997	7'463'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		1'954'706	2'011'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		6'984'492	7'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		27'000	30'162		GBP/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		2'131'834	2'199'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		24'342	3'746'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		658'866'000	4'289'916		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		478'376'000	435'785'706		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		203'124'000	197'315'466		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		25'221'000	28'380'636		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		4'313'015	661'619'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		424'200'903	467'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		27'271'482	24'307'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		195'000'968	201'102'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		2'232'240	2'293'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		315'381	278'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		1'359'234	1'501'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		47'000	53'544		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		54'833	8'460'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		23'000	26'301		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		5'297'000	4'755'143		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		234'037	239'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		670'079'000	4'170'599		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		203'423'000	198'661'681		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		24'515'000	27'871'324		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		463'354'000	417'229'426		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		198'096'725	203'153'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		418'144'396	465'747'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		4'187'901	671'910'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		27'531'296	24'282'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		2'409'783	2'697'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		50'951	8'201'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		387'849	342'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		200'000	195'209	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		431'265	388'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		3'367'947	3'493'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		6'518'682	7'541'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		57'184	9'267'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		397'245	356'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		107'120	17'322'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		475'731'000	414'151'428	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		706'700'000	4'321'626	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2023		25'368'000	28'376'569	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		206'105'000	197'876'052	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		412'295'147	475'289'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		4'309'885	703'696'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		199'098'421	207'784'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		28'887'890	25'913'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		5'222'245	5'457'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		583'573	526'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		99'866	16'292'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		13'525'606	15'468'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		1'188'016	1'241'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		1'536'148	1'746'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		65'011	10'707'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		440'143	393'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		1'222'386	1'392'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		797'691	837'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		233'092	209'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		7'814'371	8'918'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		3'140'836	3'279'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2023		27'041'000	30'261'313	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		218'588'000	209'526'434	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		502'253'000	443'567'750	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		730'695'000	4'433'309	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		283'542	310'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		58'106	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.11.2023		8'000'000	7'084'192	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		92'567	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		167'347	180'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		13'664'025	15'520'000	CHF/USD		5'267.87	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		8'165'367	8'570'000	CHF/EUR		1'975.16	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							7'243.03	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF Verfall 04.10.2023	208'838'523	218'241'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 04.10.2023	4'411'338	726'047'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.10.2023	438'141'740	497'635'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 04.10.2023	29'982'030	26'870'000	CHF/GBP	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 04.10.2023	162'402	146'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.10.2023	876'057	994'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 04.10.2023	578'987	607'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.10.2023	1'292'708	1'451'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.10.2023	500'080'000	457'451'681	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 04.10.2023	218'848'000	211'963'042	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY Verfall 04.10.2023	726'047'000	4'450'944	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 04.10.2023	27'016'000	30'163'472	GBP/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.11.2023	444'680'343	487'679'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 03.11.2023	208'225'635	215'414'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 03.11.2023	29'823'059	26'792'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.11.2023	13'118'000	12'018'869	USD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 03.11.2023	18'882	17'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 03.11.2023	3'092'000	2'977'435	EUR/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.11.2023	1'030'140	1'124'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 03.11.2023	409'190	425'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.11.2023	823'702	921'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 03.11.2023	669'648	707'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 03.11.2023	412'734	380'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 03.11.2023	213'454'000	205'308'595	EUR/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		27'189'000	30'023'562		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		476'606'000	433'731'001		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		4'504'436	733'508'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		2'031'000	12'482		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		91'337	15'292'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		746'769'000	4'488'567		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		4'454'425	740'014'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		29'791'682	27'066'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		205'538'608	214'148'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		424'487'036	468'055'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		97'911	89'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		874'578	964'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		1'813'052	1'894'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		689'865	716'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		1'266'121	1'406'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		3'846'578	3'999'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		6'741'108	7'619'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		1'059'068	1'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		3'049'730	3'464'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		427'322	385'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		62'091	10'494'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		27'540'000	30'311'626		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		750'508'000	4'414'451		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		221'857'000	210'462'203		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		481'508'000	418'633'167		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		770'303'000	4'598'478		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		31'392'238	28'616'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		4'441'883	754'054'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		214'848'396	226'963'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		442'403'707	510'686'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		12'280'905	14'128'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		7'809'862	8'280'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		96'149	16'249'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		196'622	179'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		1'955'280	2'072'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		3'161'388	3'617'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		1'668'000	1'576'487		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		3'520'000	3'045'346		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		28'795'000	30'891'046		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		235'647'000	219'055'095		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		524'911'000	441'724'155		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		32'368'518	30'266'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		224'848'663	242'374'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		458'238'443	546'333'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		4'723'065	789'904'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		195'307	32'847'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		9'732'911	11'454'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		1'178'538	1'098'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		4'191'882	4'518'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		31'206	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		2'871'262	3'389'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		1'470'952	1'583'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		828'000	4'872		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		1'697'300	2'011'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		7'534	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		1'187'000	6'991		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		902'887	974'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		81'507	13'915'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		5'377'375	6'265'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		2'504'569	2'681'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		421'467	388'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		2'113'550	2'439'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		187'598	171'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		1'103'576	1'173'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		11'225	1'918'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		52'093	8'874'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		211'255	192'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		578'643	524'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		81'082	13'783'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		4'912'000	4'275'867		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		2'903'718	3'367'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		570'346'000	489'137'285		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		253'303'000	235'994'806		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		859'226'000	5'043'012		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		32'675'000	35'685'217	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		485'499'444	567'910'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		234'653'783	252'349'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		5'051'759	859'511'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		34'984'115	32'128'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		28'018'000	165'285	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		391'000	426'061	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		1'096'000	1'020'534	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		2'485'000	2'134'287	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		27'057	4'616'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		455'982	419'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		1'864'834	2'108'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		14'494	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		877'664	925'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		8'882	8'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		678'672	715'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		1'139'419	1'288'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		59'114	10'077'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		175'997	159'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		1'229'060	1'397'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		651'477	685'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		13'318	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		2'590'000	2'468'291	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		118'000	131'272	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		5'826'000	5'134'442	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		14'489	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		801'012	840'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		1'560'624	1'776'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		1'176'182	1'337'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		43'847	46'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		846'186'000	4'978'882	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		567'505'000	499'687'017	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		32'243'000	35'912'253	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		251'874'000	240'007'712	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		4'943'985	839'033'000	CHF/JPY		0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		473'271'494	539'259'000	CHF/USD		-0.01	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		34'811'868	31'351'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		227'148'433	238'865'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-0.01	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'438'731.16	0.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	125'299'224.26	14.15
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	753'683'121.40	85.09
Derivative Finanzinstrumente	7'243.02	0.00
Sonstige Vermögenswerte	3'326'243.15	0.38
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	885'754'562.99	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-15'515'462.98	
Andere Verbindlichkeiten	-3'949.25	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	870'235'150.76	

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);	878'982'345.66	99.24
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	7'243.02	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

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
JPY	100 = CHF	0.58832800
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	764'143'978.92	87.809

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
DTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
MTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
NT CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
XT CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012
XTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.60	-	0.452	0.00 - 0.10	-	0.012

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

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: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DTH1 CHF	0.220	0.450	0.170	0.050	3.000
GTH1 CHF	0.190	0.400	0.140	0.050	3.000
MTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
XTH1 CHF	0.330	0.550	0.230	0.100	3.000

Periode: 08.02.2024-29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
XT CHF	0.310	0.500	0.210	0.100	3.000

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

FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index TR

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 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	3.300	1.155	2.145
DTH1 CHF	Nein	CHF	2.910	1.018	1.892
GTH1 CHF	Nein	CHF	2.573	0.900	1.673
MTH1 CHF	Nein	CHF	2.672	0.935	1.737
NT CHF	Nein	CHF	3.590	1.256	2.334
NTH1 CHF	Nein	CHF	3.200	1.120	2.080
XT CHF	Nein	CHF	2.634	0.921	1.713
XTH1 CHF	Nein	CHF	2.525	0.883	1.642

11 Fussnoten

- 1) Der 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.

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert am 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 der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in

Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der 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 Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund I

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
"Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den betroffenen Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zwei Teilvermögen des Umbrella-Fonds miteinander zu vereinigen und den Fondsvertrag gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil 1 dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	8. Februar 2024

2 Begründung für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Transparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 des Fondsvertrages geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die Zulässigkeit der geplanten Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist in § 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swissscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Der Fondsvertrag der zu vereinigenden Teilvermögen stimmt nach der Durchführung der in Teil II dieser Veröffentlichung beantragten Änderungen des Fondsvertrages der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 8. Februar 2024 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen DT CHF, NT CHF und XT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen DT CHF, NT CHF und XT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 8. Februar 2024 umgetauscht.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Massnahme	Ausführungsdatum der Massnahme
DT CHF	DT CHF	Umtausch	8. Februar 2024
NT CHF	NT CHF	Umtausch	8. Februar 2024
XT CHF	XT CHF	Umtausch	8. Februar 2024

Am 9. Februar 2024 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse vom 8. Februar 2024 durchgeführt. Am 9. Februar 2024 (Bewertungstag) erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf den 8. Februar 2024.

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 4. Oktober 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie der Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 13.00 Uhr)	5. Februar 2024
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 13.00 Uhr)	5. Februar 2024
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	6. Februar bis 9. Februar 2024

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene der an der Vereinigung beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

II Änderungen im Fondsvertrag

Im Hinblick auf die Vereinigung erfolgt in der Anlagepolitik eine Angleichung der teilvermögensspezifischen Bestimmungen des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens.

In § 8 Ziff. 5 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich mittels indirekten und direkten Anlagen den Referenzindex FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index, Currency-Hedged in CHF nachbildet. Bis anhin war der FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index der massgebende Referenzindex.

Die erwähnte Angleichung in der Anlagepolitik wird nach erfolgter Vereinigung nicht mehr massgeben sein, da das übernehmende Teilvermögen infolge beantragter Anpassung der Anlagepolitik (vgl. Teil 2 dieser Veröffentlichung) die bisherige Anlagepolitik des übertragenden Teilvermögens wiederum übernehmen wird.

Teil 2 – Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF und Anpassung in der Anlagepolitik

1 Umbenennung des Teilvermögens

Die Bezeichnung des Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 3 und 6 (nach Vereinigung neue Ziff. 5), § 10 Ziff. 2, § 11 Ziff. 2, § 15 Ziff. 10 und 19, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

2 Anpassung der Anlagepolitik

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird entsprechend auch der Referenzindex in § 8 Ziff. 5 des angepassten Fondsvertrages geändert. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex lautet FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index.

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

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

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund I**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
"Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World
(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen")

und

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF
(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

hinsichtlich

Vereinigungen vom 8. Februar 2024

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigungen;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

1 Vollzug der Vereinigungen

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 8. Februar 2024 vereinigt. Die Anlegerinnen und Anleger wurden mittels Publikation vom 27. November 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über dessen Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 8. Februar 2024 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnis

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anlegerinnen und Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 8. Februar 2024:

Übertragendes Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
	DT CHF	CH0117052495	CHF 109.91
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	NT CHF	CH0117052487	CHF 112.33
	XT CHF	CH0309788617	CHF 90.98

Übernehmendes Teilvermögen

des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	DT CHF	CH1300028359	CHF 109.91
	NT CHF	CH1300028367	CHF 112.33
	XT CHF	CH1300028375	CHF 90.98

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergeben sich folgende Umtauschverhältnisse aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile des übernehmenden Teilvermögens):

Übertragende Teilvermögen

des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	DT CHF	1 zu 1
	NT CHF	1 zu 1
	XT CHF	1 zu 1

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 23. Februar 2024 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World (übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund I») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund I») per 8. Februar 2024 geprüft.

Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH), wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss dem Fondsvertrag ordnungsgemäss durchgeführt.

Ernst & Young AG
Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber"

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Februar 2024

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich