

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE

Jahresbericht per 31.01.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	277967	CHF
BA CHF	42725059	CHF
CT CHF	44168701	CHF
DA CHF	2561683	CHF
GT CHF	20594562	CHF
NT CHF	21580119	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate, bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Januar 2024, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



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 Jahresrechnung“ 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 Jahresrechnung

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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 Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung 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 Unvollständigkeiten, 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

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Januar 2024, der Erfolgsrechnung 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 II	25
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	26
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	26
7	Pauschale Verwaltungskommission	27
8	Benchmark	27
9	TER	27
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	28
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	28
12	Fussnoten	28
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	29
14	Pflichtpublikationen	31

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		791'808'030.23	795'295'053.50	933'394'838.88	902'583'938.30
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		85'935'977.42	105'716'398.64	142'942'516.80	182'335'646.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'463'637.686	1'674'928.534	1'955'512.971	2'407'440.233
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		58.7140	63.1170	73.0972	75.7400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		58.6787	63.0475	73.0606	75.8400
Ausschüttung je Anteil		0.75	0.45	0.40	0.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.96 %	0.96 %	0.96 %	0.96 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		985'288.61	1'019'261.94	589'661.01	810'037.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'600.540	12'132.889	6'052.683	8'022.298
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		78.1942	84.0082	97.4214	100.9700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		78.1472	83.9158	97.3727	101.1000
Ausschüttung je Anteil		1.25	0.85	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.59 %	0.59 %	0.59 %	0.59 %
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'767'210.04	3'063'553.70	3'675'136.14	4'156'655.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		33'220.519	34'490.386	35'954.366	39'566.894
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.2982	88.8234	102.2167	105.0500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		83.2482	88.7257	102.1656	105.1900
Thesaurierung je Anteil		1.43	0.95	1.11	1.34
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	0.50 %	0.50 %	0.50 %
Klasse DA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'981'047.30	16'614'787.89	19'733'724.77	20'938'776.15
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		222'405.473	229'335.473	234'785.473	240'212.203
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		67.3592	72.4475	84.0500	87.1700
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		67.3188	72.3678	84.0080	87.2800
Ausschüttung je Anteil		1.15	0.90	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.46 %	0.46 %	0.46 %	0.46 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'141'834.06	61'808'776.29	69'762'668.81	58'761'597.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		123'284.618	641'812.618	629'920.618	516'627.618
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		90.3749	96.3035	110.7484	113.7400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		90.3207	96.1975	110.6930	113.8900
Thesaurierung je Anteil		1.65	1.15	1.32	1.58
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.39 %	0.39 %	0.39 %	0.39 %

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		675'996'672.80	607'072'275.04	696'691'131.35	635'581'225.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'288'655.084	6'157'135.698	6'159'104.505	5'484'630.170
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		92.7464	98.5965	113.1157	115.8800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.6908	98.4881	113.0591	116.0300
Thesaurierung je Anteil		2.05	1.56	1.79	2.05
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.01 %	0.01 %	0.01 %	0.01 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	-6.24 %	-4.50 %	-15.35 %	-3.05 %
Klasse BA CHF	-5.89 %	-4.15 %	-15.04 %	-2.68 %
Klasse CT CHF	-5.80 %	-4.06 %	-14.96 %	-2.60 %
Klasse DA CHF	-5.81 %	-4.07 %	-14.83 %	-2.55 %
Klasse GT CHF	-5.75 %	-4.00 %	-14.77 %	-2.49 %
Klasse NT CHF	-5.39 %	-3.64 %	-14.45 %	-2.12 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	24'545'764.93	18'605'931.30
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	723'248'174.07	719'683'659.93
Strukturierte Produkte	0.00	11'618'074.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	36'998'734.10	40'577'336.17
Derivative Finanzinstrumente	327'379.82	-54'083.46
Sonstige Vermögenswerte	6'773'636.04	4'981'655.46
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	791'893'688.96	795'412'573.40
Andere Verbindlichkeiten	-85'658.73	-117'519.90
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	791'808'030.23	795'295'053.50

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'674'928.534	1'955'512.971
Ausgegebene Anteile		6'197.602	3'422.235
Zurückgenommene Anteile		-217'488.450	-284'006.672
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'463'637.686	1'674'928.534
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'132.889	6'052.683
Ausgegebene Anteile		1'307.651	6'200.206
Zurückgenommene Anteile		-840.000	-120.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'600.540	12'132.889
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		34'490.386	35'954.366
Ausgegebene Anteile		1'927.000	728.439
Zurückgenommene Anteile		-3'196.867	-2'192.419
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		33'220.519	34'490.386
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		229'335.473	234'785.473
Zurückgenommene Anteile		-6'930.000	-5'450.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		222'405.473	229'335.473
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		641'812.618	629'920.618
Ausgegebene Anteile		46'638.000	59'416.000
Zurückgenommene Anteile		-565'166.000	-47'524.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		123'284.618	641'812.618
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		6'157'135.698	6'159'104.505
Ausgegebene Anteile		1'555'951.000	394'801.511
Zurückgenommene Anteile		-62'213.000	-396'770.318
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-362'218.614	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'288'655.084	6'157'135.698

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	13.11.2023	33'235'876.03	362'218.614

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		795'295'053.50	933'394'838.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-943'824.95	-979'288.82
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'653'235.16	-4'179'712.45
Saldo aus dem Anteilverkehr		43'080'018.06	-18'510'372.04
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-41'969'981.22	-114'430'412.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		791'808'030.23	795'295'053.50

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		345'824.01	5'899.36
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-10'208.43	-41'953.78
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		15'143'296.62	11'716'887.99
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'162'002.06	990'961.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'133'274.63	306'247.88
Total Ertrag		18'774'188.89	12'978'042.68
Aufwand			
Passivzinsen		-3.45	-95.16
Reglementarische Vergütungen		-1'101'668.13	-1'470'344.11
Sonstige Aufwendungen		-168.48	-135.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'122'214.87	-284'605.39
Total Aufwand		-2'224'054.93	-1'755'179.66
Nettoertrag / Verlust			
		16'550'133.96	11'222'863.02
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-79'095'524.40	-52'378'490.00
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		69'059.34	0.00
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		164'336.05	99'665.08
Realisierter Erfolg		-62'311'995.05	-41'055'961.90
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		20'342'013.83	-73'374'450.17
Gesamterfolg		-41'969'981.22	-114'430'412.07

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'074'187.68	605'057.37
Vortrag des Vorjahres	50'191.30	198'851.77
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'124'378.98	803'909.14
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'097'728.26	753'717.84
Vortrag auf neue Rechnung	26'650.72	50'191.30
Total	1'124'378.98	803'909.14
Klasse BA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	16'077.94	10'288.08
Vortrag des Vorjahres	206.07	230.95
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	16'284.01	10'519.03
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	15'750.68	10'312.96
Vortrag auf neue Rechnung	533.33	206.07
Total	16'284.01	10'519.03
Klasse CT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	47'578.73	33'081.51
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	47'578.73	33'081.51
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	16'652.56	11'578.53
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	30'926.17	21'502.98
Total	47'578.73	33'081.51
Klasse DA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	264'027.53	186'028.61
Vortrag des Vorjahres	631.62	21'004.94
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	264'659.15	207'033.55
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	255'766.29	206'401.93
Vortrag auf neue Rechnung	8'892.86	631.62
Total	264'659.15	207'033.55
Klasse GT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	203'878.52	738'280.44
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	203'878.52	738'280.44
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	71'357.48	258'398.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	132'521.04	479'882.29
Total	203'878.52	738'280.44
Klasse NT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	14'944'383.56	9'650'127.01
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	14'944'383.56	9'650'127.01
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'230'534.25	3'377'544.45
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	9'713'849.31	6'272'582.56
Total	14'944'383.56	9'650'127.01

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							760'246'908.17	96.00	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							723'248'174.07	91.33	
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	2'500	0	1'000	1'500 AUD	97.08%	825'775.92	0.10	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	700	1'500	0	2'200 AUD	57.85%	721'749.88	0.09	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	2'000	0	1'300	700 AUD	91.73%	364'144.73	0.05	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	0	1'000	0	1'000 AUD	88.53%	502'020.45	0.06	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	600	0	0	600 AUD	79.45%	270'314.26	0.03	a)
AU3CB0246221	4.0500 % VZ 4.05 02/17/25 MTN	1'800	0	0	1'800 AUD	99.30%	1'013'591.69	0.13	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	2'000	0	0	2'000 AUD	96.30%	1'092'210.77	0.14	a)
AU3CB0264703	2.9000 % STANLN 2.9 06/28/25	400	0	0	400 AUD	98.96%	224'462.29	0.03	a)
AU3CB0279818	0.8000 % ASIA 0.8 11/06/25 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	94.19%	534'111.61	0.07	a)
AU3CB0297547	4.5000 % QTC 4 1/2 03/09/33	0	1'500	0	1'500 AUD	100.60%	855'743.36	0.11	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	1'700	0	0	1'700 AUD	82.66%	796'864.96	0.10	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	2'000	0	0	2'000 AUD	75.96%	861'533.26	0.11	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	76.50%	867'669.09	0.11	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	3'000	0	0	3'000 AUD	88.54%	1'506'265.51	0.19	a)
AUD							10'436'457.78	1.32	
CA110709EK47	5.7000 % BRCOL 5.7 06/18/29	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	4'000	0	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	5'200	0	1'100	4'100 CAD	90.74%	2'388'621.53	0.30	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	12'000	0	12'000 CAD	82.95%	6'390'948.76	0.81	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	1'100	0	1'100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	6'000	0	6'000 CAD	99.15%	3'819'652.47	0.48	a)
CA135087WV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	1'000	0	1'000	0 CAD	204.35%	0.00	0.00	
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	4'000	0	0	4'000 CAD	108.47%	2'785'956.23	0.35	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	2'000	0	2'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	4'000	0	4'000	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA64953BAU22	2.0000 % NYLIFE 2 04/17/28 MPLE	500	0	500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	2'000	0	0	2'000 CAD	88.64%	1'138'244.85	0.14	a)
CA74814ZFL28	2.8500 % Q 2.85 12/01/53	0	1'500	0	1'500 CAD	77.71%	748'447.52	0.09	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	2'000	0	0	2'000 CAD	89.14%	1'144'650.09	0.14	a)
US052591AT11	5.0000 % AUST 5 12/20/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	1'500	0	1'500	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	2'500	0	0	2'500 CAD	89.73%	1'440'388.37	0.18	a)
CAD							19'856'909.82	2.51	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204501139	0.0000 % SWNBK 0 10/23/23 84	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	3'000	0	3'000 CHF	104.80%	3'144'000.00	0.40	a)
CHF							3'144'000.00	0.40	
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	4'000	0	0	4'000 CNY	110.92%	530'579.16	0.07	a)
CND10000H9K9	3.5200 % CGB 3.52 05/04/27 1710	50'000	0	50'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000HWX0	3.5900 % CGB 3.59 08/03/27 1718	30'000	0	15'000	15'000 CNY	105.30%	1'888'890.31	0.24	a)
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	30'000	0	0	30'000 CNY	106.73%	3'828'885.88	0.48	a)
CND10001RRB3	3.2500 % CGB 3 1/4 11/22/28 1827	40'000	0	0	40'000 CNY	104.65%	5'005'557.11	0.63	a)
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	10'000	0	0	10'000 CNY	100.02%	1'196'065.57	0.15	a)
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	50'000	0	0	50'000 CNY	105.16%	6'287'362.23	0.79	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	20'000	0	0	20'000 CNY	106.23%	2'540'714.09	0.32	a)
CND10002LTC8	2.2400 % CGB 2.24 03/05/23 INBK	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	65'000	0	10'000	55'000 CNY	112.60%	7'405'779.20	0.94	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004NXW0	2.8900 % CGB 2.89 11/18/31 INBK	32'500	0	7'500	25'000 CNY	102.95%	3'077'806.03	0.39	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	0	55'000	30'000	25'000 CNY	103.32%	3'088'771.76	0.39	a)
CND100067578	2.8000 % CGB 2.8 03/25/30 INBK	0	25'000	0	25'000 CNY	102.17%	3'054'571.12	0.39	a)
CND10006GPT1	2.6700 % CGB 2.67 05/25/33 INBK	0	65'000	0	65'000 CNY	101.65%	7'900'929.66	1.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND1000716X4	3.0000 % CGB 3 10/15/53 INBK	0	12'000	0	12'000 CNY	107.29%	1'539'634.14	0.19	a)
CND1000716Y2	2.5500 % CGB 2.55 10/15/28 INBK	0	20'000	0	20'000 CNY	101.10%	2'417'953.81	0.31	a)
CND100076348	2.6700 % CGB 2.67 11/25/33 INBK	0	25'000	0	25'000 CNY	102.05%	3'050'816.23	0.39	a)
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	29'000	0	19'000	10'000 CNY	99.39%	1'188'579.69	0.15	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	25'000	0	25'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	99.91%	2'389'452.48	0.30	a)
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	100.24%	3'595'945.65	0.45	a)
XS2366200850	2.5500 % IBRD 2.55 07/19/23	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CNY							59'988'294.12	7.58	
XS1821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	0	10'000'000	0	10'000'000 COP	88.26%	1'935'807.10	0.24	a)
COP							1'935'807.10	0.24	
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	4'500	0	0	4'500 DKK	103.00%	579'476.33	0.07	a)
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	3'000	0	0	3'000 DKK	125.95%	472'392.60	0.06	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'000	0	0	8'000 DKK	98.59%	986'043.70	0.12	a)
DKK							2'037'912.63	0.26	
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	1'500	0	0	1'500 EUR	87.85%	1'227'929.43	0.16	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	1'700	0	0	1'700 EUR	101.98%	1'615'490.15	0.20	a)
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	2'100	0	0	2'100 EUR	103.78%	2'030'789.81	0.26	a)
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A33SH3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	2'220	0	2'220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	1'500	1'500	0	3'000 EUR	102.59%	2'867'917.60	0.36	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	2'300	0	2'300 EUR	99.54%	2'133'368.39	0.27	a)
BE0002922038	3.2500 % WALLOO 3 1/4 06/22/33 EMTN	0	3'700	1'700	2'000 EUR	101.13%	1'884'791.31	0.24	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	0	2'000 EUR	93.13%	1'735'697.24	0.22	a)
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	2'500	0	0	2'500 EUR	99.56%	2'319'414.50	0.29	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	0	2'700	0	2'700 EUR	104.36%	2'625'633.21	0.33	a)
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	3'100	1'600	1'500 EUR	102.69%	1'435'370.53	0.18	a)
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	2'200	0	2'200 EUR	101.26%	2'075'812.49	0.26	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	3'500	6'500	0	10'000 EUR	87.87%	8'187'780.34	1.03	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	2'500	1'500	1'000	3'000 EUR	54.00%	1'509'689.27	0.19	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	1'000	3'000	0	4'000 EUR	97.32%	3'627'309.60	0.46	a)
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	0	12'000	12'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	0	10'500	0	10'500 EUR	94.48%	9'244'205.00	1.17	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	4'000	8'000	5'000	7'000 EUR	92.43%	6'029'345.51	0.76	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	3'350	0	3'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V5C3	5.3750 % DB 5 3/8 01/11/29	2'600	0	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	0	2'100	0	2'100 EUR	101.19%	1'980'126.71	0.25	a)
DE000A30VHW7	1.5000 % NIESA 1 1/2 10/17/29	1'200	0	0	1'200 EUR	94.43%	1'055'943.83	0.13	a)
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	0	2'000	0	2'000 EUR	103.91%	1'936'471.04	0.24	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	2'000	1'500	0	3'500 EUR	101.01%	3'294'242.77	0.42	a)
DE000A351U49	5.8240 % ALVGR 5.824 07/25/53	0	2'100	0	2'100 EUR	109.69%	2'146'440.22	0.27	a)
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	3'200	0	3'200 EUR	100.58%	2'999'206.11	0.38	a)
DE000A3E5MK0	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/14/41	0	1'000	0	1'000 EUR	64.72%	603'057.55	0.08	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	82.41%	767'964.91	0.10	a)
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3.7 05/30/31 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	7'000	0	7'000 EUR	102.16%	6'663'759.41	0.84	a)
DE000LB2CNE0	0.3750 % LBBW 0 3/8 09/30/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	675	0	675	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NRW0NP7	3.0000 % NRW 3 01/27/28	1'000	0	0	1'000 EUR	101.66%	947'306.44	0.12	a)
DE000NWB0AL1	0.0000 % NRWK 0 02/03/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	83.15%	1'549'627.84	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	3'000	0	0	3'000 EUR	92.54%	2'586'968.46	0.33	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	1'600	0	0	1'600 EUR	100.27%	1'494'891.68	0.19	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	3'700	3'800	2'500	5'000 EUR	100.94%	4'703'079.22	0.59	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	6'000	1'500	4'500 EUR	104.33%	4'374'839.31	0.55	a)
ES0000090888	0.7000 % ANDAL 0.7 07/30/33	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000101012	1.7230 % MADRID 1.723 04/30/32	1'000	0	0	1'000 EUR	89.34%	832'466.73	0.11	a)
ES0200002089	3.9000 % ADIFAL 3.9 04/30/33 EMTN	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0200002097	3.5000 % ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0205046008	4.2500 % AENASM 4 1/4 10/13/30 EMTN	0	800	0	800 EUR	105.30%	784'943.00	0.10	a)
ES0344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G30R0	3.3750 % EU 3 3/8 04/04/38 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	104.18%	2'912'338.31	0.37	a)
EU000A3K4D09	2.7500 % EU 2 3/4 12/04/37 SURE	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4D56	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DVO	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	1'350	1'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EA2	0.0000 % EUB 0 01/12/24 6M	0	6'000	6'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4EB0	0.0000 % EUB 0 02/09/24 6M	0	6'000	3'000	3'000 EUR	99.93%	2'793'473.06	0.35	a)
EU000A3K7MW2	1.6250 % EU 1 5/8 12/04/29 NGEU	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	0	3'000	0	3'000 EUR	55.34%	1'547'093.24	0.20	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013203825	1.2500 % LIFP 1 1/4 09/29/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	84.18%	784'411.85	0.10	a)
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003067	0.0000 % IDF 0 04/20/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140055E7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	83.12%	774'571.64	0.10	a)
FR00140060B0	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009HA0	2.5000 % BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	2'000	1'800	2'000	1'800 EUR	80.27%	1'346'375.35	0.17	a)
FR001400A3H2	1.5000 % CADES 1 1/2 05/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	91.09%	1'188'296.50	0.15	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	2'450	1'550	0	4'000 EUR	95.59%	3'562'975.51	0.45	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CVE3	2.7500 % CADES 2 3/4 11/25/32 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400DNU4	3.1250 % SNCF 3 1/8 11/02/27	1'300	0	0	1'300 EUR	100.94%	1'222'800.60	0.15	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400E797	4.0000 % BPCEGP 4 11/29/32 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F0V4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F5U5	3.0000 % CADES 3 05/25/28 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FDB0	4.2500 % EDF 4 1/4 01/25/32 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	1'400	0	1'400 EUR	95.54%	1'246'389.14	0.16	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	3'000	0	3'000 EUR	103.19%	2'884'690.68	0.36	a)
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	0	4'000	0	4'000 EUR	101.75%	3'792'580.38	0.48	a)
FR001400ITG9	3.3750 % BPCECB 3 3/8 06/27/33	0	3'000	0	3'000 EUR	103.03%	2'880'329.68	0.36	a)
FR001400KDS4	5.5000 % ACAFP 5 1/2 08/28/33 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	105.24%	2'451'642.30	0.31	a)
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	106.18%	1'780'982.70	0.22	a)
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	0	3'900	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	0	3'200	1'700	1'500 EUR	106.09%	1'482'810.40	0.19	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400MLX3	5.3750 % ILDFP 5 3/8 02/15/29	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE000GVLBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	2'000	0	0	2'000 EUR	83.70%	1'559'896.69	0.20	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	8'000	2'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	2'500	5'000	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	1'000	0	0	1'000 EUR	103.36%	963'138.37	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	0	3'000	3'000	0 EUR	100.30%	0.00	0.00	
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	3'200	1'200	2'000 EUR	104.00%	1'938'260.17	0.24	a)
IT0005568529	4.1250 % BPSOIM 4 1/8 10/24/28	0	2'500	0	2'500 EUR	103.51%	2'411'340.31	0.30	a)
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	0	2'700	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	0	3'000	0	3'000 EUR	100.53%	2'810'330.01	0.35	a)
PTEDPUOM0008	3.8750 % EDPPL 3 7/8 06/26/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	102.42%	1'049'786.25	0.13	a)
PTOTEPOE0032	1.1500 % PGB 1.15 04/11/42	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTEYOE0031	1.6500 % PGB 1.65 07/16/32	2'000	0	0	2'000 EUR	92.04%	1'715'252.71	0.22	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	0	1'600	0	1'600 EUR	101.75%	1'517'032.15	0.19	a)
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	0	5'000	0	5'000 EUR	97.76%	4'554'684.03	0.58	a)
XS1206541366	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1439749364	1.6250 % TEVA 1 5/8 10/15/28	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1578127778	1.4500 % TMO 1.45 03/16/27	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1797138960	2.6250 % IBESM 2 5/8 PERP EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2018637327	1.1250 % HEIGR 1 1/8 12/01/27 EMTN	1'250	0	1'250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	0	2'000	0	2'000 EUR	85.16%	1'587'013.18	0.20	a)
XS2112475921	1.0000 % PLD 1 02/06/35	0	1'000	0	1'000 EUR	74.17%	691'172.15	0.09	a)
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2177013765	0.7500 % RKTLLN 0 3/4 05/19/30 REGS	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193666042	0.3750 % DBHNGR 0 3/8 06/23/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	1'700	0	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	1'800	0	0	1'800 EUR	82.42%	1'382'487.80	0.17	a)
XS2235996217XXX	0.0000 % NOVNVX 0 09/23/28	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	78.02%	726'973.36	0.09	a)
XS2289593670	0.0100 % DNBNO 0.01 01/21/31	1'000	0	0	1'000 EUR	82.00%	764'116.42	0.10	a)
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	0	4'000	2'000	2'000 EUR	78.51%	1'463'097.37	0.18	a)
XS2347663507	0.3750 % AZN 0 3/8 06/03/29 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2358287238	0.0100 % UBS 0.01 06/29/26 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	92.80%	1'297'118.40	0.16	a)
XS2366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2387052744	0.8750 % CASTSS 0 7/8 09/17/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	79.15%	737'549.72	0.09	a)
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2390400716	0.3750 % ENELIM 0 3/8 05/28/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	86.07%	2'406'070.76	0.30	a)
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	1'500	0	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404214020	0.9000 % PG 0.9 11/04/41	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406607098	3.7500 % TEVA 3 3/4 05/09/27	0	2'000	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2407197545	0.2500 % AUCCCN 0 1/4 11/17/31 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	81.68%	761'087.95	0.10	a)
XS2432130610	2.0000 % TTEFP 2 PERP	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	2'100	0	0	2'100 EUR	91.79%	1'796'221.04	0.23	a)
XS2433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2435663393	0.2500 % KUNTA 0 1/4 02/25/32 EMTN	1'400	0	0	1'400 EUR	82.37%	1'074'550.77	0.14	a)
XS2461234622	1.9630 % JPM 1.963 03/23/30 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2475513953	1.8500 % ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 EUR	90.82%	1'269'414.86	0.16	a)
XS2475954900	1.3750 % KFW 1 3/8 06/07/32	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2482618464	2.5000 % NDAFH 2 1/2 05/23/29 EMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2485162163	2.2500 % EVKGR 2 1/4 09/25/27 EMTN	1'800	0	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	96.42%	1'527'412.82	0.19	a)
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	2'100	0	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2524746687	4.1250 % INTNED 4 1/8 08/24/33	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2532681074	3.7500 % FERROV 3 3/4 04/14/27 EMTN	1'550	0	1'550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	1'050	0	1'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2539371653	3.3000 % ONTTF 3.3 10/05/29 REGS	2'500	0	1'000	1'500 EUR	101.46%	1'418'178.12	0.18	a)
XS2547290432	2.5000 % DENK 2 1/2 11/18/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2552369469	4.6250 % REESM 4 5/8 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2554581830	7.0000 % ASRND 7 12/07/43	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	750	0	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 EUR	102.24%	1'238'560.77	0.16	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	1'000	2'000	1'000	2'000 EUR	100.81%	1'878'715.72	0.24	a)
XS2574870759	3.5000 % MOTOPG 3 1/2 07/17/31 EMTN	1'400	0	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575971994	4.0000 % ABNAV 4 01/16/28 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576298991	2.8750 % COE 2 7/8 01/17/33 EMTN	2'200	0	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	1'100	2'000	3'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	1'100	0	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2580271596	3.8750 % PLD 3 7/8 01/31/30 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2584643113	3.6250 % NDAFH 3 5/8 02/10/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2585932275	3.5530 % BDX 3.553 09/13/29	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2587748174	2.7500 % RENTEN 2 3/4 02/16/32 EMTN	0	2'200	2'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2588986997	5.0000 % INTNED 5 02/20/35 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	102.46%	2'864'143.65	0.36	a)
XS2589907653	5.5000 % UBS 5 1/2 08/20/26 EMTN	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2590268814	3.0000 % KUNTA 3 09/25/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	101.84%	1'043'923.12	0.13	a)
XS2590764713	3.0000 % BNG 3 02/23/28 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592088400	3.3550 % ROSW 3.355 02/27/35	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2592659671	4.2500 % VFC 4 1/4 03/07/29 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	0	1'700	1'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596458591	4.2500 % BXBAA 4 1/4 03/22/31 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2596599063	4.6990 % NWG 4.699 03/14/28 EMTN	0	1'300	550	750 EUR	102.80%	718'426.08	0.09	a)
XS2597093009	4.0500 % TOYOTA 4.05 09/13/29 EMTN	0	1'100	1'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	0	2'050	2'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597696124	4.0000 % DNBNO 4 03/14/29 EMTN	0	2'350	1'000	1'350 EUR	102.65%	1'291'267.39	0.16	a)
XS2597740476	4.1090 % NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN	0	1'150	1'150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2611177382	3.1000 % IBRD 3.1 04/14/38 GMTN	0	2'300	0	2'300 EUR	101.00%	2'164'745.24	0.27	a)
XS2613209670	4.3750 % SYDAU 4 3/8 05/03/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 EUR	105.21%	980'405.32	0.12	a)
XS2613658710	4.3750 % ABNAV 4 3/8 10/20/28	0	2'700	1'200	1'500 EUR	103.56%	1'447'475.11	0.18	a)
XS2613821300	3.0000 % NEDWBK 3 04/20/33	0	1'825	1'825	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618499177	3.7500 % SHBASS 3 3/4 05/05/26 EMTN	0	1'600	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2619751576	3.8750 % SEB 3 7/8 05/09/28 EMTN	0	3'050	3'050	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2623518821	4.7710 % NWG 4.771 02/16/29 EMTN	0	2'500	0	2'500 EUR	103.76%	2'417'117.70	0.31	a)
XS2624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2625196352	4.8750 % ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	2'800	1'000	1'800 EUR	105.60%	1'771'304.63	0.22	a)
XS2626022573	4.1250 % WPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	102.76%	1'149'101.53	0.15	a)
XS2631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	102.29%	1'525'142.87	0.19	a)
XS2631835332	3.5000 % STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	103.20%	1'442'443.18	0.18	a)
XS2634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	0	3'400	3'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	0	3'500	0	3'500 EUR	104.70%	3'414'622.25	0.43	a)
XS2637069357	6.7500 % ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	108.50%	1'617'655.74	0.20	a)
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	0	1'400	1'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	1'400	0	1'400 EUR	105.66%	1'378'424.99	0.17	a)
XS2644969698	5.1250 % O 5 1/8 07/06/34	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	0	1'650	1'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	2'500	500	2'000 EUR	107.86%	2'010'198.06	0.25	a)
XS2673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	0	5'650	1'650	4'000 EUR	104.33%	3'888'783.32	0.49	a)
XS2675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	0	3'600	3'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	2'400	0	2'400 EUR	103.97%	2'325'218.91	0.29	a)
XS2676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2676779304	3.6660 % TD 3.666 09/08/31	0	5'000	2'000	3'000 EUR	103.99%	2'906'915.01	0.37	a)
XS2679765037	6.3750 % LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	104.23%	2'913'875.84	0.37	a)
XS2681541327	6.1250 % ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRNE3 3 5/8 12/12/28	0	900	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2695009998	7.8750 % GLJGR 7 7/8 04/06/27 EMTN	0	4'400	4'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	101.97%	2'090'388.30	0.26	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	2'600	0	2'600 EUR	107.00%	2'592'276.21	0.33	a)
XS2722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	107.96%	1'207'237.04	0.15	a)
XS2723597923	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/26 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	100.29%	2'803'620.78	0.35	a)
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	0	2'350	350	2'000 EUR	104.53%	1'948'100.38	0.25	a)
XS2739132897	3.8750 % ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN	0	1'700	0	1'700 EUR	101.46%	1'607'252.70	0.20	a)
XS2740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	0	2'800	0	2'800 EUR	100.67%	2'626'732.11	0.33	a)
XS2742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	1'950	0	1'950 EUR	101.84%	1'850'427.45	0.23	a)
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	102.09%	1'902'701.23	0.24	a)
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	0	2'100	0	2'100 EUR	98.32%	1'923'945.27	0.24	a)
XS2745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	1'800	0	1'800 EUR	100.56%	1'686'634.28	0.21	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	2'000	0	2'000 EUR	101.94%	1'899'831.17	0.24	a)
XS2754067242	4.4899 % MEX 4.4899 05/25/32	0	3'200	0	3'200 EUR	101.55%	3'027'951.44	0.38	a)
EUR							228'901'391.15	28.91	
DE000A3LSV01	5.6250 % TRAGR 5 5/8 01/16/29 EMTN	0	2'900	400	2'500 GBP	100.60%	2'747'486.17	0.35	a)
FR0014003N10	2.0000 % BNP 2 05/24/31 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FNA1	4.0000 % BPIFRA 4 01/30/26 EMTN	0	400	400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	0	1'700	0	1'700 GBP	104.74%	1'945'157.37	0.25	a)
FR001400NCB6	5.7500 % SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN	0	3'200	1'700	1'500 GBP	101.08%	1'656'291.81	0.21	a)
GB00BFMCM652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	1'500	0	1'500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	1'400	1'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	2'900	1'000	3'000	900 GBP	76.63%	753'415.56	0.10	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'900	1'000	0	3'900 GBP	52.13%	2'220'984.79	0.28	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	1'000	5'400	0	6'400 GBP	30.50%	2'132'421.56	0.27	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	1'000	1'000	0	1'000 GBP	77.60%	847'724.97	0.11	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	0	2'500	0	2'500 GBP	69.26%	1'891'540.95	0.24	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	5'000	1'000	6'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS0295479983	4.5000 % EIB 4 1/2 03/07/44 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	700	0	0	700 GBP	83.33%	637'224.81	0.08	a)
XS1979281158	2.5000 % VZ 2 1/2 04/08/31	700	0	0	700 GBP	85.88%	656'755.25	0.08	a)
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	500	0	500	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2114778140	1.7500 % UU 1 3/4 02/10/38 EMTN	300	0	300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	400	0	400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2200513153	1.1250 % NGGLN 1 1/8 07/07/28 EMTN	1'000	0	500	500 GBP	85.84%	468'854.17	0.06	a)
XS2251337353	1.1250 % VZ 1 1/8 11/03/28	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2281152822	0.6250 % MET 0 5/8 12/08/27	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2297626645	0.8750 % FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN	700	0	700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2384533563	1.6250 % ICBCAS 1 5/8 12/28/25 GMTN	800	0	800	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	900	0	0	900 GBP	41.30%	406'006.73	0.05	a)
XS2476782631	2.1250 % NRW 2 1/8 06/13/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 GBP	96.35%	1'578'849.51	0.20	a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	97.03%	2'119'880.48	0.27	a)
XS2523960719	5.1250 % ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN	1'700	0	1'700	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2540612129	6.3750 % NWG 6 3/8 11/08/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 GBP	104.79%	1'488'183.36	0.19	a)
XS2556930696	4.2500 % KOMMUN 4 1/4 11/17/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2590262296	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN	0	2'100	600	1'500 GBP	100.87%	1'652'834.27	0.21	a)
XS2592761527	4.3750 % CPPIBC 4 3/8 03/02/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2598063480	6.5000 % ISPIM 6 1/2 03/14/29 EMTN	0	1'200	1'200	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X52630420268	6.6250 % ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	105.68%	1'731'685.80	0.22	a)
X52692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	2'450	650	1'800 GBP	103.83%	2'041'625.41	0.26	a)
GBP							26'976'922.97	3.41	
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	95.13%	1'674'924.45	0.21	a)
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	98.44%	1'155'372.86	0.15	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	1'200'000	250'000	1'450'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	750'000	0	750'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	320'000	180'000	500'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	1'900'000	0	1'900'000 JPY	101.01%	11'262'496.87	1.42	a)
JP1120231J51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/28 23	600'000	0	600'000	0 JPY	113.54%	0.00	0.00	
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	1'030'000	890'000	430'000	1'490'000 JPY	91.30%	7'983'535.40	1.01	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	600'000	850'000	0	1'450'000 JPY	92.05%	7'832'948.78	0.99	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	900'000	0	200'000	700'000 JPY	96.47%	3'962'917.42	0.50	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	800'000	100'000	0	900'000 JPY	80.39%	4'245'868.51	0.54	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	520'000	200'000	120'000	600'000 JPY	79.92%	2'814'099.84	0.36	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	0	440'000	0	440'000 JPY	100.32%	2'590'417.42	0.33	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP582667AP59	1.3520 % LLOYDS 1.352 05/25/29 11	0	300'000	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	460'000	0	460'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US500769CG75	2.6000 % KFW 2.6 06/20/37	940'000	0	0	940'000 JPY	122.28%	6'745'730.23	0.85	a)
X50171578502	1.0500 % DBJJP 1.05 06/20/23 INTL	225'000	0	225'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X50241594778	1.9000 % EIB 1.9 01/26/26 REGS	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X50257403278	2.3000 % DBJJP 2.3 03/19/26 INTL	540'000	0	0	540'000 JPY	104.29%	3'305'011.88	0.42	a)
X50307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	107.34%	629'922.05	0.08	a)
X51512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X51580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	0	200'000	400'000 JPY	99.99%	2'347'319.15	0.30	a)
X51645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.55%	2'336'872.96	0.30	a)
X52351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	300'000	0	0	300'000 JPY	97.36%	1'714'038.60	0.22	a)
X52548076301	1.0540 % TMO 1.054 10/20/27	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	0	400'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
X52634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	0	340'000	0	340'000 JPY	99.64%	1'988'058.01	0.25	a)
JPY							62'589'534.43	7.90	
KR103502GB33	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/51 5103	0	3'200'000	0	3'200'000 KRW	74.73%	1'537'103.04	0.19	a)
KR103502GD31	3.2500 % KTB 3 1/4 03/10/53 5303	0	4'000'000	0	4'000'000 KRW	98.89%	2'542'564.87	0.32	a)
KRW							4'079'667.91	0.52	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	350'000	0	350'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	0	850'000	0	850'000 MXN	89.75%	3'810'242.38	0.48	a)
MXN							3'810'242.38	0.48	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	2'000	0	2'000	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	0	12'000	0	12'000 MYR	98.34%	2'140'279.57	0.27	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200 MYR	100.66%	36'511.77	0.00	a)
MYR							2'176'791.34	0.27	
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	12'600	0	0	12'600 NOK	101.38%	1'047'998.84	0.13	a)
NOK							1'047'998.84	0.13	
NZIIBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	1'200	0	0	1'200 NZD	124.66%	789'933.09	0.10	a)
NZD							789'933.09	0.10	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	3'000	0	0	3'000 PLN	103.20%	666'776.36	0.08	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	3'000	0	0	3'000 PLN	95.05%	614'119.11	0.08	a)
X52433824757	3.9000 % KFW 3.9 01/18/24 EMTN	2'500	0	2'500	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PLN							1'280'895.47	0.16	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000 SEK	114.22%	474'155.28	0.06	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	6'200	0	6'200	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	5'000	0	0	5'000 SEK	96.20%	399'336.72	0.05	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	5'000	0	0	5'000 SEK	86.43%	358'795.30	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	10'000	0	0	10'000 SEK	87.71%	728'209.59	0.09	a)
SEK							1'960'496.89	0.25	
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	400	0	400	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	400	0	0	400 SGD	103.89%	266'762.56	0.03	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	0	500	0	500 SGD	99.91%	320'678.69	0.04	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	0	1'150	0	1'150 SGD	82.29%	607'485.67	0.08	a)
SGD							1'194'926.92	0.15	
TH0623035605	0.9500 % THAIGB 0.95 06/17/25	40'000	0	0	40'000 THB	98.19%	949'745.59	0.12	a)
TH0623038302	5.6700 % THAIGB 5.67 03/13/28	9'000	0	0	9'000 THB	112.95%	245'806.12	0.03	a)
TH0623A3N603	3.4500 % THAIGB 3.45 06/17/43	0	33'000	0	33'000 THB	105.65%	843'038.90	0.11	a)
THB							2'038'590.61	0.26	
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	0	1'900	0	1'900 USD	101.74%	1'658'340.72	0.21	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	0	1'200	0	1'200 USD	71.21%	733'051.85	0.09	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	91.44%	1'568'870.39	0.20	a)
US00216NAF69	5.3980 % ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS	2'100	0	0	2'100 USD	101.53%	1'828'993.68	0.23	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MAV72	2.4500 % AER 2.45 10/29/26	0	1'500	0	1'500 USD	92.75%	1'193'492.91	0.15	a)
US00774MAW55	3.0000 % AER 3 10/29/28	1'500	0	0	1'500 USD	90.57%	1'165'415.74	0.15	a)
US013051EE35	3.3500 % ALTA 3.35 11/01/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02079KAH05	0.4500 % GOOGL 0.45 08/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BQ82	0.8000 % AMZN 0.8 06/03/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02343UAI43	5.6250 % AMCR 5 5/8 05/26/33	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816BW85	3.7000 % AXP 3.7 08/03/23	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816CM94	1.6500 % AXP 1.65 11/04/26	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAX84	2.7500 % AMT 2 3/4 01/15/27	1'500	0	0	1'500 USD	94.31%	1'213'542.16	0.15	a)
US031162BY57	3.1250 % AMGN 3 1/8 05/01/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CZ14	2.0000 % AMGN 2 01/15/32	1'450	3'050	0	4'500 USD	81.94%	3'163'054.26	0.40	a)
US035240AL43	4.0000 % ABIBB 4 04/13/28	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AT01	4.1000 % ELV 4.1 05/15/32	650	2'400	3'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US036752AX13	6.1000 % ELV 6.1 10/15/52	90	0	90	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AT77	4.4500 % AAPL 4.45 05/06/44	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	5'500	0	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	2'000	0	0	2'000 USD	64.99%	1'114'948.06	0.14	a)
US045167FP34	3.1250 % ASIA 3 1/8 08/20/27 GMTN	3'900	0	0	3'900 USD	96.97%	3'244'122.62	0.41	a)
US04636NAG88	4.9000 % AZN 4.9 03/03/30	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05581LAG41	5.8940 % BNP 5.894 12/05/34 REGS	0	3'400	0	3'400 USD	104.52%	3'048'641.06	0.38	a)
US05723KAF75	4.0800 % BHI 4.08 12/15/47	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	800	4'800	1'600	4'000 USD	90.69%	3'111'950.08	0.39	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	0	1'500	0	1'500 USD	94.62%	1'217'603.05	0.15	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	88.56%	759'732.68	0.10	a)
US06051GKB40	2.9720 % BAC 2.972 07/21/52	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLA57	4.8270 % BAC 4.827 07/22/26 MTN	3'500	0	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	2'950	0	2'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06368FAC32	1.2500 % BMO 1 1/4 09/15/26 MTN	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06407F2C54	1.0000 % BZLNZ 1 03/03/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06407F2E11	2.2850 % BZLNZ 2.285 01/27/27 REGS	1'650	0	0	1'650 USD	92.68%	1'311'813.07	0.17	a)
US06417XAD30	1.9500 % BNS 1.95 02/02/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	0	4'000	0	4'000 USD	101.87%	3'495'564.23	0.44	a)
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	0	4'000	0	4'000 USD	101.30%	3'476'098.24	0.44	a)
US06675GAY17	1.6040 % BFCM 1.604 10/04/26 REGS	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EAU91	4.3370 % BACR 4.337 01/10/28	0	2'000	0	2'000 USD	97.25%	1'668'502.84	0.21	a)
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	0	700	0	700 USD	100.84%	605'513.01	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US10112RBB96	3.4000 % BXP 3.4 06/21/29	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122CQ99	4.1250 % BMV 4 1/8 06/15/39	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	1'500	0	0	1'500 USD	92.17%	1'185'969.00	0.15	a)
US126650DE72	2.6250 % CVS 2 5/8 08/15/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	1'300	0	1'300 USD	100.90%	1'125'266.01	0.14	a)
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	2'050	0	0	2'050 USD	97.95%	1'722'599.62	0.22	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	0	2'430	2'430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US136375CP57	3.6500 % CNRCN 3.65 02/03/48	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135BAV36	3.3750 % CNC 3 3/8 02/15/30	0	2'500	0	2'500 USD	89.56%	1'920'743.61	0.24	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	0	1'750	0	1'750 USD	104.02%	1'561'543.15	0.20	a)
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	2'000	0	0	2'000 USD	73.96%	1'269'014.25	0.16	a)
US172967MF56	3.3520 % C 3.352 04/24/25	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967NX53	5.6100 % C 5.61 09/29/26	1'500	0	0	1'500 USD	100.77%	1'296'678.11	0.16	a)
US191216DP21	2.2500 % KO 2 1/4 01/05/32	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US191241AH15	2.7500 % KOF 2 3/4 01/22/30	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	2'900	0	2'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20271RAQ39	5.0790 % CBAAU 5.079 01/10/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CG98	4.7500 % CAF 4 3/4 04/01/26	2'050	0	0	2'050 USD	99.53%	1'750'411.61	0.22	a)
US219868CH71	6.0000 % CAF 6 04/26/27	0	2'550	0	2'550 USD	103.50%	2'264'140.28	0.29	a)
US22535EAG26	5.5140 % ACAFP 5.514 07/05/33 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	103.71%	1'779'318.16	0.22	a)
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	0	2'500	0	2'500 USD	98.83%	2'119'425.66	0.27	a)
US22822VBC46	5.1000 % CCI 5.1 05/01/33	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EWK18	4.1500 % DE 4.15 09/15/27 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CQ02	4.1620 % DB 4.162 05/13/25	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	119.07%	1'021'401.51	0.13	a)
US25243YBC21	1.3750 % DGELN 1 3/8 09/29/25	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25243YBE86	2.1250 % DGELN 2 1/8 04/29/32	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NAY13	2.5000 % ENBCN 2 1/2 01/15/25	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBH70	1.6000 % ENBCN 1.6 10/04/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBX21	6.0000 % ENBCN 6 11/15/28	0	550	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29278GAP37	2.2500 % ENELIM 2 1/4 07/12/31 144A	2'000	0	0	2'000 USD	81.52%	1'398'657.22	0.18	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	2'110	0	2'110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JT41	3.2500 % EIB 3 1/4 11/15/27	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JU14	3.8750 % EIB 3 7/8 03/15/28	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JV96	3.7500 % EIB 3 3/4 02/14/33	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29881WAD48	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 144A	0	1'500	0	1'500 USD	93.74%	1'206'173.44	0.15	a)
US30216BJU70	3.3750 % EDC 3 3/8 08/26/25	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8J41	4.4500 % META 4.45 08/15/52	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	1'200	0	200	1'000 USD	101.61%	871'669.32	0.11	a)
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	0	2'400	1'400	1'000 USD	105.83%	907'863.22	0.11	a)
US37045XEHS2	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	1'400	400	1'000 USD	102.62%	880'335.84	0.11	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	1'250	0	0	1'250 USD	93.14%	998'791.55	0.13	a)
US38143U8H71	3.7500 % GS 3 3/4 02/25/26	2'000	0	0	2'000 USD	97.79%	1'677'828.26	0.21	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	0	675	0	675 USD	100.95%	584'561.07	0.07	a)
US404280CL16	2.0130 % HSBC 2.013 09/22/28	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280DQ93	7.3360 % HSBC 7.336 11/03/26	1'400	0	0	1'400 USD	103.78%	1'246'374.56	0.16	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	2'450	0	2'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.53%	793'760.57	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US42824CBL28	5.9000 % HPE 5.9 10/01/24	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	0	1'800	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	7'000	3'000	4'000 USD	100.41%	3'445'382.06	0.44	a)
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	1'700	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CF51	5.1250 % INTC 5 1/8 02/10/30	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	900	0	0	900 USD	94.54%	729'896.25	0.09	a)
US4581X0DQ82	0.6250 % IADB 0 5/8 09/16/27	2'000	0	0	2'000 USD	88.58%	1'519'841.14	0.19	a)
US4581X0EF19	3.5000 % IADB 3 1/2 09/14/29	2'100	0	0	2'100 USD	97.42%	1'755'049.25	0.22	a)
US4581X0EH74	4.0000 % IADB 4 01/12/28	2'000	0	0	2'000 USD	99.88%	1'713'565.91	0.22	a)
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	3'400	0	3'400 USD	95.21%	2'777'028.07	0.35	a)
US4581X0EN43	4.1250 % IADB 4 1/8 02/15/29	0	6'350	0	6'350 USD	100.57%	5'478'237.39	0.69	a)
US459058JE46	0.3750 % IBD 0 3/8 07/28/25	2'000	0	0	2'000 USD	94.08%	1'614'194.92	0.20	a)
US459058JL88	0.5000 % IBD 0 1/2 10/28/25	0	1'500	0	1'500 USD	93.53%	1'203'497.01	0.15	a)
US459058JX27	0.8750 % IBD 0 7/8 07/15/26	2'300	0	0	2'300 USD	92.36%	1'822'395.72	0.23	a)
US459058JZ74	1.1250 % IBD 1 1/8 09/13/28	1'600	0	0	1'600 USD	87.93%	1'206'892.67	0.15	a)
US459058KA05	1.6250 % IBD 1 5/8 11/03/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KJ14	3.1250 % IBD 3 1/8 06/15/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058KL69	3.6250 % IBD 3 5/8 09/21/29	1'800	0	0	1'800 USD	98.05%	1'514'002.51	0.19	a)
US459058L07	2.1250 % IBD 2 1/8 03/03/25 GDIF	0	2'500	0	2'500 USD	97.30%	2'086'617.87	0.26	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	3'800	0	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	2'900	0	2'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410BX58	2.3750 % ITALY 2 3/8 10/17/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US465410BZ07	4.0000 % ITALY 4 10/17/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	2'500	0	0	2'500 USD	99.99%	2'144'346.20	0.27	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	1'100	6'000	1'100	6'000 USD	85.91%	4'421'700.62	0.56	a)
US46647PDE34	3.8450 % JPM 3.845 06/14/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDM59	5.5460 % JPM 5.546 12/15/25	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US478160CJ19	2.6250 % JNJ 2 5/8 01/15/25	825	0	825	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US487836BZ07	5.2500 % K 5 1/4 03/01/33	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500630DZ86	5.3750 % KDB 5 3/8 10/23/26	0	2'600	0	2'600 USD	102.03%	2'275'651.37	0.29	a)
US50064FAN42	3.8750 % KOREA 3 7/8 09/20/48	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50066RAR75	1.7500 % KOROL 1 3/4 04/18/25 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JT24	3.0000 % KFW 3 05/20/27	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JU96	3.1250 % KFW 3 1/8 06/10/25	2'000	0	0	2'000 USD	98.12%	1'683'376.57	0.21	a)
US500769JW52	3.7500 % KFW 3 3/4 02/15/28	1'300	0	0	1'300 USD	99.01%	1'104'200.82	0.14	a)
US50249AAJ25	3.6250 % LYB 3 5/8 04/01/51	0	2'000	0	2'000 USD	72.07%	1'236'530.98	0.16	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US563469UY98	1.5000 % MP 1 1/2 10/25/28 HB	2'500	0	0	2'500 USD	88.63%	1'900'713.67	0.24	a)
US56501RAK23	2.4840 % MFCCN 2.484 05/19/27	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629XCW65	5.0500 % MASSMU 5.05 12/07/27 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US581557BQ70	0.9000 % MCK 0.9 12/03/25	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GEW50	2.8000 % MET 2.8 03/21/25 144A	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59217GEZ81	3.3000 % MET 3.3 03/21/29 144A	0	3'000	0	3'000 USD	93.06%	2'394'959.14	0.30	a)
US59217HEP82	1.5500 % MET 1.55 01/07/31 REGS	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	0	4'000	0	4'000 USD	102.81%	3'527'993.12	0.45	a)
US6174468V45	0.9850 % MS 0.985 12/10/26	1'800	0	0	1'800 USD	92.44%	1'427'337.78	0.18	a)
US61747YEC57	1.5120 % MS 1.512 07/20/27 GMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	0	725	725	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	500	0	0	500 USD	91.81%	393'802.91	0.05	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	0	5'000	0	5'000 USD	101.16%	4'339'005.30	0.55	a)
US65559D2E87	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 REGS	2'800	0	0	2'800 USD	91.50%	2'197'787.68	0.28	a)
US66989HAN89	3.1000 % NOVNVX 3.1 05/17/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67077MAW82	2.9500 % NTRCN 2.95 05/13/30	0	3'000	0	3'000 USD	89.96%	2'315'209.00	0.29	a)
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US676167CB35	0.3750 % OKB 0 3/8 09/17/25	0	1'500	0	1'500 USD	93.61%	1'204'592.72	0.15	a)
US676167CG22	4.6250 % OKB 4 5/8 11/03/25	1'300	0	0	1'300 USD	100.24%	1'117'891.83	0.14	a)
US682680BN20	6.6250 % OKE 6 5/8 09/01/53	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US683234AQ19	1.0500 % ONT 1.05 05/21/27	2'300	0	0	2'300 USD	90.34%	1'782'449.34	0.23	a)
US683234AU21	2.1250 % ONT 2 1/8 01/21/32 MTN	1'950	0	0	1'950 USD	85.72%	1'433'977.43	0.18	a)
US68329AAH14	1.2500 % ONTTFT 1 1/4 09/27/30 144A	2'000	0	0	2'000 USD	81.77%	1'402'933.47	0.18	a)
US68389XCN30	4.6500 % ORCL 4.65 05/06/30	0	2'400	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	97.18%	833'624.32	0.11	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	3'000	0	1'000	2'000 USD	88.91%	1'525'377.40	0.19	a)
US713448DY13	3.0000 % PEP 3 10/15/27	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74256LEK17	0.8750 % PFG 0 7/8 01/12/26 144A	2'800	0	0	2'800 USD	92.22%	2'215'184.43	0.28	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XCG43	4.8750 % PLD 4 7/8 06/15/28	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XCH26	5.1250 % PLD 5 1/8 01/15/34	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US748148SB04	1.3500 % Q 1.35 05/28/30	1'000	0	0	1'000 USD	84.36%	723'698.56	0.09	a)
US748148SD69	3.6250 % Q 3 5/8 04/13/28	0	3'100	0	3'100 USD	97.92%	2'604'143.19	0.33	a)
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	0	1'500	0	1'500 USD	98.49%	1'267'396.17	0.16	a)
US748149AQ48	2.5000 % Q 2 1/2 04/09/24 QW	1'500	0	0	1'500 USD	99.46%	1'279'762.08	0.16	a)
US74977SDJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	93.24%	1'599'632.90	0.20	a)
US756109BS20	4.7000 % O 4.7 12/15/28	0	2'100	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	98.73%	846'972.46	0.11	a)
US78015K7H17	1.1500 % RY 1.15 06/10/25 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EZQ33	1.2000 % RY 1.2 04/27/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.55%	793'946.71	0.10	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	100.16%	859'205.99	0.11	a)
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	1'000	0	1'000 USD	100.85%	865'148.64	0.11	a)
US78016HZW32	5.1500 % RY 5.15 02/01/34 GMTN	0	1'785	0	1'785 USD	100.38%	1'537'121.01	0.19	a)
US78081BAK98	2.2000 % RPRX 2.2 09/02/30	0	3'500	0	3'500 USD	83.86%	2'517'944.15	0.32	a)
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	0	4'000	1'000	3'000 USD	100.47%	2'585'673.76	0.33	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	550	750	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBF21	6.4990 % SANUSA 6.499 03/09/29	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AX63	6.2000 % SJM 6.2 11/15/33	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'850	0	2'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBD90	2.8890 % SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS	0	4'000	1'500	2'500 USD	82.57%	1'770'816.86	0.22	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	0	1'500	0	1'500 USD	99.97%	1'286'376.10	0.16	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	0	1'850	0	1'850 USD	103.28%	1'639'035.03	0.21	a)
US87031CAE30	2.2500 % SEK 2 1/4 03/22/27 GMTN	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	0	3'000	0	3'000 USD	91.03%	2'342'680.30	0.30	a)
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	0	1'800	0	1'800 USD	100.89%	1'557'881.28	0.20	a)
US874060BD74	3.3750 % TACHEM 3 3/8 07/09/60	0	2'000	0	2'000 USD	69.24%	1'187'990.59	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89153VAQ23	3.4550 % TTEFP 3.455 02/19/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US904764BK20	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/14/30	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US907818FT00	3.2000 % UNP 3.2 05/20/41	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZD42	0.0000 % B 11/30/23	0	7'000	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZN24	0.0000 % B 12/28/23	0	11'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZY88	0.0000 % B 01/25/24	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797HZ39	0.0000 % B 01/16/24	0	17'000	17'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797JA69	0.0000 % B 01/23/24	0	10'000	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	3'500	2'000	5'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	5'000	3'000	0	8'000 USD	85.33%	5'855'898.22	0.74	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	7'000	6'000	3'000	10'000 USD	79.95%	6'858'778.40	0.87	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	0	8'500	0	8'500 USD	80.91%	5'899'461.26	0.74	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	6'000	11'500	0	17'500 USD	69.16%	10'381'995.59	1.31	a)
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	0	7'000	0	7'000 USD	92.52%	5'555'778.21	0.70	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	8'500	4'500	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	0	14'000	14'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	0	27'000	6'000	21'000 USD	81.81%	14'738'399.16	1.86	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	0	7'000	0	7'000 USD	93.98%	5'643'715.03	0.71	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	2'900	7'100	0	10'000 USD	88.48%	7'590'632.54	0.96	a)
US91282CEJ62	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/27	2'000	5'000	7'000	0 USD	102.84%	0.00	0.00	
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	0	5'000	0	5'000 USD	99.59%	4'271'824.92	0.54	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	8'000	3'000	5'000 USD	95.59%	4'100'254.92	0.52	a)
US91324PDX78	2.0000 % UNH 2 05/15/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEE88	3.0500 % UNH 3.05 05/15/41	0	2'500	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGL27	2.8500 % VZ 2.85 09/03/41	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92826CAM47	2.0500 % V 2.05 04/15/30	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106BAC54	2.2000 % WCNCN 2.2 01/15/32	380	0	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94988J6D46	5.4500 % WFC 5.45 08/07/26 BKNT	0	2'000	0	2'000 USD	101.57%	1'742'659.53	0.22	a)
US95000U2S19	2.3930 % WFC 2.393 06/02/28 MTN	0	2'000	0	2'000 USD	92.28%	1'583'212.08	0.20	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	2'500	0	0	2'500 USD	88.56%	1'899'222.64	0.24	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USC68012AA85	2.5000 % OMERFT 2 1/2 05/02/24 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	99.26%	1'703'038.13	0.22	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	3'200	0	3'200 USD	105.72%	2'902'085.96	0.37	a)
USF0803NAC68	4.5240 % BFCM 4.524 07/13/25 REGS	1'980	0	0	1'980 USD	99.33%	1'687'077.83	0.21	a)
USF11494CB90	6.5080 % BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS	0	825	825	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF2893TAC02	6.9500 % EDF 6.95 01/26/39 REGS	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USF29416AB40	5.7000 % EDF 5.7 05/23/28 REGS	0	650	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	90.93%	1'170'103.11	0.15	a)
USG6398ADD66	5.2640 % NWIDE 5.264 11/10/26 REGS	0	3'100	0	3'100 USD	101.91%	2'710'101.71	0.34	a)
USG6594TAC79	2.3320 % NAB 2.332 08/21/30 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG84228GC69	6.0970 % STANLN 6.097 01/11/35 REGS	0	2'550	0	2'550 USD	102.28%	2'237'392.90	0.28	a)
USH42097CT27	2.7460 % UBS 2.746 02/11/33 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	82.19%	1'057'600.37	0.13	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH4209UAC02	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USJ5539RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	1'350	0	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	0	1'350	0	1'350 USD	103.43%	1'197'796.62	0.15	a)
USQ66511AB43	5.7500 % NCMAU 5 3/4 11/15/41 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU3644QAF29	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU5876JAE56	4.9500 % MBGGR 4.95 03/30/25 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BL90	2.3750 % ROSW 2 3/8 01/28/27 REGS	2'500	0	2'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BV72	2.3140 % ROSW 2.314 03/10/27 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	107.53%	1'291'388.52	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBF79	2.5000 % HYUCAP 2 1/2 01/24/27 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBG52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	100.05%	1'716'554.11	0.22	a)
USY3815NBH36	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/29 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	100.41%	1'722'789.39	0.22	a)
USY5257YAM94	6.5360 % LENOVO 6.536 07/27/32 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1800010693	4.0000 % ADCBUH 4 03/29/23 REGS	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1865437930	3.8750 % STSP 3 7/8 08/28/28 EMTN	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2176713613	1.0000 % JFM 1 05/21/25 REGS	850	0	0	850 USD	94.90%	691'984.70	0.09	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2224639802	0.6250 % JFM 0 5/8 09/02/25 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	93.43%	1'603'029.98	0.20	a)
XS2225366694	0.8500 % SEB 0.85 09/02/25 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2233188353	1.6250 % QNBK 1 5/8 09/22/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	93.91%	1'611'222.07	0.20	a)
XS2233217558	1.7100 % EDPL 1.71 01/24/28 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2233264550	0.3750 % CADES 0 3/8 09/23/25 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	93.53%	1'283'755.37	0.16	a)
XS2249473724	0.6250 % KOLAHO 0 5/8 11/03/23 GMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2270152098	0.5000 % LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 USD	93.01%	2'473'438.95	0.31	a)
XS2280635256	1.6380 % EBIUH 1.638 01/13/26	3'000	0	0	3'000 USD	93.24%	2'399'610.78	0.30	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	81.69%	1'401'631.63	0.18	a)
XS2297244878	0.6250 % IDBINV 0 5/8 02/10/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 USD	92.57%	2'223'486.25	0.28	a)
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	92.85%	1'194'709.07	0.15	a)
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'400	0	0	1'400 USD	92.39%	1'109'626.97	0.14	a)
XS2343566662	0.8750 % BNG 0 7/8 05/18/26 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	92.20%	1'581'789.62	0.20	a)
XS2348714713	3.1270 % UCGIM 3.127 06/03/32 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	84.39%	1'085'935.16	0.14	a)
XS2396652682	1.3750 % LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 USD	88.30%	1'287'696.18	0.16	a)
XS2402074277	1.2500 % CADES 1 1/4 10/28/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	92.43%	1'982'362.67	0.25	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	88.49%	1'518'209.89	0.19	a)
XS2408003650	1.5380 % SWEDA 1.538 11/16/26 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	82.52%	1'061'802.20	0.13	a)
XS2427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	1'600	0	0	1'600 USD	92.07%	1'263'647.36	0.16	a)
XS2481608029	3.0000 % RENTEN 3 05/21/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 USD	95.00%	1'222'441.26	0.15	a)
XS2532478190	6.3000 % EDPL 6.3 10/11/27 REGS	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2580013386	4.3750 % FABUH 4 3/8 04/24/28 EMTN	2'200	0	0	2'200 USD	97.97%	1'848'874.75	0.23	a)
XS2613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	0	3'000	1'500	1'500 USD	98.30%	1'264'861.22	0.16	a)
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	100.01%	1'201'074.07	0.15	a)
XS2625207571	5.3750 % BGOSK 5 3/8 05/22/33 REGS	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD							289'001'400.62	36.49	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							36'998'734.10	4.67	
IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	10'477'252	0	0	10'477'252 USD	4.12	36'998'734.10	4.67	a)
USD							36'998'734.10	4.67	
Nicht kotierte Wertpapiere							0.00	0.00	
Strukturierte Produkte							0.00	0.00	
CH0473236351	ZKB TRACKER DYN LS BOND F 2025	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							327'379.82	0.04	
Optionen und Optionsscheine							0.00	0.00	
DE000C70NFQ2	EURO-BUND OPTION OCT23P 131	0	0	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000C70NFZ3	EURO-BUND OPTION OCT23C 133.5	0	0	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Futures								0.00	0.00
03/23	EURO-BUND FUTURE MAR23	-200	430	230	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BOBL FUTURE MAR23	0	120	120	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO-BUXL 30Y BND MAR23	15	13	28	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 10YR NOTE (CBT)MAR23	-200	410	210	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US ULTRA BOND CBT MAR23	220	25	245	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	US 5YR NOTE (CBT) MAR23	-140	140	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUND FUTURE JUN23	0	820	820	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BOBL FUTURE JUN23	0	200	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO-BUXL 30Y BND JUN23	0	56	56	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 10YR NOTE (CBT)JUN23	0	585	585	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US ULTRA BOND CBT JUN23	0	380	380	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	US 5YR NOTE (CBT) JUN23	0	390	390	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUND FUTURE SEP23	0	280	280	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO-BUXL 30Y BND SEP23	0	45	45	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 10YR NOTE (CBT)SEP23	0	175	175	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US ULTRA BOND CBT SEP23	0	258	258	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 5YR NOTE (CBT) SEP23	0	190	190	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	US 2YR NOTE (CBT) SEP23	0	220	220	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	0	78	78	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BTP FUTURE DEC23	0	60	60	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	0	425	425	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	0	360	360	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US ULTRA BOND CBT DEC23	0	275	275	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	LONG GILT FUTURE DEC23	0	145	145	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	0	20	20	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	0	215	215	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	50	180	-130 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	140	110	30 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO-SCHATZ FUT MAR24	0	10	0	10 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	10	50	-40 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	US 10YR NOTE (CBT)MAR24	0	90	0	90 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	US 10YR ULTRA FUT MAR24	0	150	150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US ULTRA BOND CBT MAR24	0	290	210	80 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	165	75	90 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	0	530	150	380 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	US 2YR NOTE (CBT) MAR24	0	180	230	-50 USD	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte									
USD/CHF	Verfall 23.02.2023		6'438'607	7'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 23.02.2023		4'000'000	3'705'836	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.02.2023		4'528'560	5'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.02.2023		500'000'000	3'571'885	JPY/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		3'674'980	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 20.04.2023		700'000'000	4'818'478	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 20.04.2023		4'000'000	3'718'688	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		5'581'140	6'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		7'937'992	8'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 20.04.2023		4'000'000	3'753'804	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		3'924'452	4'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		3'661'240	4'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		2'941'008	3'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 20.04.2023		1'713'190	250'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 20.04.2023		3'000'000	2'770'842	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 20.04.2023		5'000'000	4'911'270	EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		5'465'718	6'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 20.04.2023		3'000'000	2'989'053	EUR/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 20.04.2023		4'944'215	5'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 21.04.2023		6'500'000'000	4'607'119	KRW/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 21.04.2023		4'426'888	6'500'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CAD/AUD	Verfall 02.05.2023		443'478	400'000	AUD/CAD		0.00	0.00	
DKK/AUD	Verfall 02.05.2023		738'799	3'300'000	AUD/DKK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.05.2023		8'045'271	9'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 17.05.2023		11'791'632	12'000'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 17.05.2023		450'000'000	3'013'043	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 17.05.2023		4'000'000	3'940'252	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.05.2023		3'000'000	2'679'558	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.05.2023		3'000'000	2'665'614	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 13.07.2023		550'000'000	3'629'483	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 13.07.2023		8'746'353	9'000'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.07.2023		8'021'511	9'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.07.2023		4'300'000	3'902'783		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 13.07.2023		4'005'771	6'600'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.07.2023		1'600'000	1'439'078		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 13.07.2023		1'507'380	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 13.07.2023		7'800'000	4'750'676		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.07.2023		2'447'758	2'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.07.2023		2'063'513	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 13.07.2023		2'800'000	1'902'415		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.07.2023		1'800'000	1'617'174		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 13.07.2023		4'196'972	4'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 13.07.2023		568'127	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.07.2023		1'710'319	1'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 13.07.2023		585'900'000	3'652'471		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.07.2023		2'225'465	2'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 14.07.2023		8'000'000'000	5'428'930		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 14.07.2023		4'200'000'000	2'892'562		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 14.07.2023		8'339'565	12'200'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 14.09.2023		565'451	500'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.09.2023		4'999'812	5'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 14.09.2023		2'800'000	1'853'765		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.09.2023		1'135'900'000	7'145'174		JPY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 14.09.2023		1'483'112	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 14.09.2023		1'200'000	704'395		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.09.2023		17'346'711	17'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.09.2023		1'279'551	1'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.09.2023		32'100'000	3'898'802		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.09.2023		1'500'000	1'437'789		EUR/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 14.09.2023		744'662	1'300'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 14.09.2023		1'428'600'000	8'801'319		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 14.09.2023		6'400'000	7'094'387		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.09.2023		12'329'391	14'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.09.2023		13'039'530	13'600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 14.09.2023		28'600'000	1'127'930		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 14.09.2023		65'500'000	7'947'377		CNY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 14.09.2023		5'531'732	898'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 14.09.2023		5'700'000	5'469'931		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.09.2023		792'388	900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 14.09.2023		10'975'715	11'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.09.2023		13'900'000	12'276'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 14.09.2023		54'992'300'000	3'137'934		IDR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.09.2023		12'200'000'000	8'322'930		KRW/CHF	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 15.09.2023		3'087'482	3'970'900'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 15.09.2023		1'356'100'000	905'777		KRW/CHF	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 15.09.2023		3'970'900'000	2'991'699		KRW/USD	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 15.09.2023		9'096'131	13'556'100'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 30.10.2023		2'800'000	1'829'775		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.10.2023		7'447'507	8'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 30.10.2023		5'900'000	6'529'560		GBP/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 30.10.2023		57'168	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 30.10.2023		1'666'000'000	10'140'825		JPY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 30.10.2023		1'486'706	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 30.10.2023		97'600'000	11'862'402		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 30.10.2023		28'600'000	1'101'623		CZK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.10.2023		34'094'309	35'800'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.10.2023		3'800'000	3'375'859		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 30.10.2023		3'920'293	4'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 30.10.2023		1'745'065'300	11'000'000		JPY/EUR	0.00	0.00	
	KRW/USD Verfall 31.10.2023		2'997'277	3'970'900'000		USD/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 31.10.2023		13'556'100'000	9'079'705		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 31.10.2023		54'992'300'000	3'185'836		IDR/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 31.10.2023		3'101'985	54'992'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 31.10.2023		8'961'461	13'556'100'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	USD/KRW Verfall 31.10.2023		3'970'900'000	2'922'635		KRW/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 28.11.2023		56'455	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/JPY Verfall 28.11.2023		1'738'522'500	11'000'000		JPY/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 28.11.2023		97'600'000	11'950'437		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 28.11.2023		2'800'000	1'816'074		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 28.11.2023		5'900'000	6'386'426		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.11.2023		4'120'896	4'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 28.11.2023		1'666'000'000	9'966'445		JPY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 28.11.2023		1'415'724	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 28.11.2023		37'727'525	39'900'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	CHF/CZK Verfall 28.11.2023		28'600'000	1'091'250		CZK/CHF	0.00	0.00		
	CNY/EUR Verfall 28.11.2023		3'314'229	25'900'000		EUR/CNY	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 28.11.2023		7'422'323	7'700'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 28.11.2023		9'800'000	8'832'662		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 28.11.2023		200'000	192'855		EUR/CHF	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 28.11.2023		1'988'951	334'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 28.11.2023		1'216'998	1'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 28.11.2023		500'000	450'471		USD/CHF	0.00	0.00		
	GBP/USD Verfall 28.11.2023		2'885'060	2'300'000		USD/GBP	0.00	0.00		
	CHF/IDR Verfall 29.11.2023		54'992'300'000	3'093'574		IDR/CHF	0.00	0.00		
	KRW/USD Verfall 29.11.2023		2'926'297	3'970'900'000		USD/KRW	0.00	0.00		
	CHF/KRW Verfall 29.11.2023		13'556'100'000	8'953'476		KRW/CHF	0.00	0.00		
	IDR/CHF Verfall 29.11.2023		3'120'679	54'992'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00		
	KRW/CHF Verfall 29.11.2023		9'171'897	13'556'100'000		CHF/KRW	0.00	0.00		
	USD/KRW Verfall 29.11.2023		3'970'900'000	3'039'882		KRW/USD	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		2'800'000	1'798'950		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 18.01.2024		97'600'000	12'031'054		CNY/CHF	0.00	0.00		
	EUR/JPY Verfall 18.01.2024		1'783'780'900	11'000'000		JPY/EUR	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 18.01.2024		4'800'000	5'296'310		GBP/CHF	0.00	0.00		
	GBP/USD Verfall 18.01.2024		2'886'942	2'300'000		USD/GBP	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		5'700'000	5'010'773		USD/CHF	0.00	0.00		
	MXN/CHF Verfall 18.01.2024		1'482'761	29'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00		
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		1'331'600'000	7'891'927		JPY/CHF	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 18.01.2024		57'779	100'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 18.01.2024		45'562'966	47'400'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/CZK Verfall 18.01.2024		28'600'000	1'123'700		CZK/CHF	0.00	0.00		
	CNY/EUR Verfall 18.01.2024		3'321'731	25'900'000		EUR/CNY	0.00	0.00		
	CHF/JPY Verfall 18.01.2024		109'400'000	649'834		JPY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 18.01.2024		100'000	87'115		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 18.01.2024		600'000	384'265		CAD/CHF	0.00	0.00		
	EUR/JPY Verfall 18.01.2024		618'300'000	3'947'048		JPY/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 18.01.2024		1'000'748	166'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	EUR/USD Verfall 18.01.2024		3'700'000	3'326'198		USD/EUR	0.00	0.00		
	EUR/CNY Verfall 18.01.2024		24'464'797	3'100'000		CNY/EUR	0.00	0.00		
	CHF/IDR Verfall 19.01.2024		54'992'300'000	3'107'946		IDR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/KRW Verfall 19.01.2024		13'556'100'000	9'153'763		KRW/CHF	0.00	0.00		
	KRW/USD Verfall 19.01.2024		3'047'922	3'970'900'000		USD/KRW	0.00	0.00		
	IDR/CHF Verfall 19.01.2024		3'029'345	54'992'300'000		CHF/IDR	0.00	0.00		
	USD/KRW Verfall 19.01.2024		3'970'900'000	2'987'886		KRW/USD	0.00	0.00		
	KRW/CHF Verfall 19.01.2024		8'749'823	13'556'100'000		CHF/KRW	0.00	0.00		
	USD/CAD Verfall 26.01.2024		1'500'000	1'116'587		CAD/USD	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 07.03.2024		3'400'000	2'157'579		CAD/CHF	18'424.35	0.00	b)	
	CHF/CNY Verfall 07.03.2024		97'600'000	11'634'896		CNY/CHF	20'367.61	0.00	b)	
	GBP/USD Verfall 07.03.2024		2'914'670	2'300'000		USD/GBP	-12'641.32	0.00	b)	
	CHF/JPY Verfall 07.03.2024		1'275'000'000	7'517'145		JPY/CHF	-21'416.06	0.00	b)	
	EUR/JPY Verfall 07.03.2024		2'402'080'900	15'146'761		JPY/EUR	39'212.53	0.00	b)	
	CHF/USD Verfall 07.03.2024		5'800'000	4'960'723		USD/CHF	-3'567.67	0.00	b)	
	CHF/GBP Verfall 07.03.2024		4'800'000	5'201'386		GBP/CHF	23'845.08	0.00	b)	
	EUR/USD Verfall 07.03.2024		3'700'000	3'383'677		USD/EUR	16'364.13	0.00	b)	
	MXN/CHF Verfall 07.03.2024		1'461'010	29'200'000		CHF/MXN	16'066.82	0.00	b)	
	CHF/CZK Verfall 07.03.2024		28'600'000	1'078'838		CZK/CHF	-13'386.34	0.00	b)	
	CNY/EUR Verfall 07.03.2024		221'731	1'739'262		EUR/CNY	-1'547.05	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 07.03.2024		56'654	100'000		CHF/AUD	92.79	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 07.03.2024		44'317'294	47'400'000		CHF/EUR	247'373.17	0.03	b)	
	CHF/USD Verfall 07.03.2024		3'100'000	2'650'274		USD/CHF	-761.70	0.00	b)	
	GBP/USD Verfall 07.03.2024		3'400'000	2'675'838		USD/GBP	-6'984.84	0.00	b)	
	CAD/USD Verfall 07.03.2024		1'117'162	1'500'000		USD/CAD	-5'189.11	0.00	b)	
	CHF/IDR Verfall 08.03.2024		54'992'300'000	3'017'294		IDR/CHF	-39'679.08	-0.01	b)	
	CHF/KRW Verfall 08.03.2024		7'699'400'000	4'950'428		KRW/CHF	-8'894.30	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte								267'679.01	0.03	

Swaps

								Kurswert CHF	in % 7)	
01/29	IRS FIX LEG 3.75097% P.A. GBP	0	15'000	0	15'000	GBP	100.36%	16'446'137.01	2.08	b)
01/29	IRS FLOATING LEG - GBP - SONIO/N	0	0	15'000	-15'000	GBP	100.00	-16'386'436.20	-2.07	b)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	24'545'764.93	3.10
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	723'248'174.07	91.33

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	36'998'734.10	4.67
Derivative Finanzinstrumente	327'379.82	0.04
Sonstige Vermögenswerte	6'773'636.04	0.86
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	791'893'688.96	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-85'658.73	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	791'808'030.23	

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);	760'246'908.17	96.00
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	327'379.82	0.04
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

AUD	1 = CHF	0.56708174
CAD	1 = CHF	0.64207926
CNY	1 = CHF	0.11958264
COP	1'000 = CHF	0.21934000
CZK	100 = CHF	3.74292400
DKK	100 = CHF	12.50182200
EUR	1 = CHF	0.93183793
GBP	1 = CHF	1.09242908
IDR	10'000 = CHF	0.54360000
JPY	100 = CHF	0.58686500
KRW	1 = CHF	0.00064275
MXN	1 = CHF	0.04994614
MYR	1 = CHF	0.18136364
NOK	100 = CHF	8.20390900
NZD	1 = CHF	0.52804957
PLN	1 = CHF	0.21536704
SEK	100 = CHF	8.30256400
SGD	1 = CHF	0.64193512
THB	100 = CHF	2.41801100
USD	1 = CHF	0.85785000
ZAR	1 = CHF	0.04612407

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	237'374'855.57	29.979
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	96'139'904.06	12.142
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	0.950	1.200	0.750	0.200	4.000
BA CHF	0.580	0.900	0.380	0.200	4.000
CT CHF	0.490	0.750	0.290	0.200	4.000
DA CHF	0.450	0.700	0.350	0.100	4.000
GT CHF	0.380	0.600	0.280	0.100	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

8 Benchmark

Dieser Fonds hat keinen Referenzindex.

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 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Ja	CHF	0.75000	0.26250	0.48750
BA CHF	Ja	CHF	1.25000	0.43750	0.81250
DA CHF	Ja	CHF	1.15000	0.40250	0.74750

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CT CHF	Ja	CHF	1.432	0.501	0.931
GT CHF	Ja	CHF	1.653	0.578	1.075
NT CHF	Ja	CHF	2.050	0.717	1.333

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts

der Art "Effektenfonds"

(nachfolgend der "Anlagefonds")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, die Anlagepolitik im Fondsvertrag des Anlagefonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Die Anlagepolitik des Anlagefonds soll in § 8 Ziff. 2 Bst. aa des Fondsvertrages präzisiert werden.

In der erwähnten Bestimmung werden bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

In der angepassten Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. aa des Fondsvertrages ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Emittenten (inkl. Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds, Collateralized Debt Obligations, Asset Backed Securities und Mortgage Backed Securities) zu den zulässigen Anlagen gehören.

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 Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. April 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich