

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 1-5 CHF

Jahresbericht per 31.01.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	21580388	CHF
FA CHF	21580386	CHF
GT CHF	33099914	CHF
NT CHF	21580389	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 Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund II,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag 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 Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte 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

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	26
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		2'474'193'344.20	2'314'393'221.36	2'073'935'353.19	1'209'271'812.85
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		206'805'953.28	220'492'119.50	196'884'697.89	183'022'923.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'203'314.560	2'402'699.628	2'056'323.507	1'882'689.120
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.8613	91.7685	95.7460	97.2136
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		100.7271	91.9703	91.7364	89.9477
Thesaurierung je Anteil		0.83	0.63	0.72	0.83
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		177'723'375.71	105'009'316.91	32'536'170.09	3'191'884.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'028'969.617	1'219'883.235	360'781.106	34'660.268
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.5929	86.0814	90.1826	92.0906
Ausschüttung je Anteil		0.80	0.65	0.60	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		794'298'132.02	798'743'891.12	635'057'215.19	108'054'749.38
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'366'258.873	8'606'625.635	6'559'856.707	1'099'524.612
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.9407	92.8057	96.8096	98.2741
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		101.8854	93.0097	92.7555	90.9289
Thesaurierung je Anteil		0.86	0.66	0.76	0.87
Total Expense Ratio (TER)		0.13 %	0.13 %	0.13 %	0.13 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'295'365'883.19	1'190'147'893.83	1'209'457'270.02	915'002'255.89
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'574'993.377	12'770'054.553	12'450'838.687	9'287'079.710
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.4229	93.1983	97.1386	98.5242
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.4029	93.4033	93.0707	91.1604
Thesaurierung je Anteil		0.99	0.79	0.89	1.00
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	2.53 %	3.24 %	-5.25 %	-0.60 %
Klasse FA CHF	2.53 %	3.25 %	-5.25 %	-0.60 %
Klasse GT CHF	2.56 %	3.28 %	-5.22 %	-0.57 %
Klasse NT CHF	2.69 %	3.41 %	-5.10 %	-0.44 %
Benchmark	2.64 %	3.44 %	-5.37 %	-0.42 %
Tracking Error 33)	0.06 %	0.09 %	0.20 %	0.05 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	-0.11 %
Klasse FA CHF	-0.11 %
Klasse GT CHF	-0.08 %
Klasse NT CHF	0.05 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	10'500'888.51	4'831'935.13
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'446'249'130.95	2'296'857'292.83
Sonstige Vermögenswerte	17'591'750.33	12'839'851.57
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'474'341'769.79	2'314'529'079.53
Andere Verbindlichkeiten	-148'425.59	-135'858.17
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'474'193'344.20	2'314'393'221.36

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'402'699.628	2'056'323.507
Ausgegebene Anteile		579'005.205	849'405.497
Zurückgenommene Anteile		-778'390.273	-503'029.376
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'203'314.560	2'402'699.628

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'219'883.235	360'781.106
Ausgegebene Anteile		1'004'637.862	930'143.153
Zurückgenommene Anteile		-195'551.480	-71'041.024
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'028'969.617	1'219'883.235

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'606'625.635	6'559'856.707
Ausgegebene Anteile		1'699'642.376	2'990'012.004
Zurückgenommene Anteile		-1'940'009.138	-943'243.076
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'366'258.873	8'606'625.635

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'770'054.553	12'450'838.687
Ausgegebene Anteile		5'098'093.868	4'067'914.874
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		443'921.790	1'002'335.004
Zurückgenommene Anteile		-3'265'889.225	-4'564'912.012
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-1'471'187.609	-186'122.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'574'993.377	12'770'054.553

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.03.2023	19'395'564.42	210'502.167
Klasse NT CHF	23.11.2023	22'026'689.41	233'419.623

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	12.09.2023	82'515'806.20	882'171.010
Klasse NT CHF	17.10.2023	19'299'249.43	205'542.071
Klasse NT CHF	10.11.2023	13'312'624.69	141'325.080
Klasse NT CHF	19.01.2024	23'031'463.59	242'149.448

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		2'314'393'221.36	2'073'935'353.19
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'023'028.78	-236'925.85
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-6'438'652.20	-6'493'612.22
Saldo aus dem Anteilverkehr		103'988'162.28	332'210'030.27
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		63'273'641.54	-85'021'624.03
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'474'193'344.20	2'314'393'221.36

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		52'973.71	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-75'192.74
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		25'888'272.32	18'805'735.68
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'376'430.40	3'721'497.52
Total Ertrag		30'317'676.43	22'452'040.46
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-1'643'233.36	-1'393'399.96
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-4'489'130.69	-2'865'065.68
Total Aufwand		-6'132'364.05	-4'258'465.64
Nettoertrag / Verlust		24'185'312.38	18'193'574.82
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-35'147'224.84	-42'922'176.99
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'576'030.02	2'344'020.82
Realisierter Erfolg		-9'385'882.44	-22'384'581.35
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		72'659'523.98	-62'637'042.68
Gesamterfolg		63'273'641.54	-85'021'624.03

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'830'582.12	1'521'472.28
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'830'582.12	1'521'472.28
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	640'703.74	532'515.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'189'878.38	988'956.98
Total	1'830'582.12	1'521'472.28
Klasse FA CHF		
Nettoertrag	1'598'157.47	797'383.24
Vortrag des Vorjahres	34'665.87	30'206.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'632'823.34	827'589.97
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'623'175.69	792'924.10
Vortrag auf neue Rechnung	9'647.65	34'665.87
Total	1'632'823.34	827'589.97
Klasse GT CHF		
Nettoertrag	7'263'983.46	5'752'106.14
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	7'263'983.46	5'752'106.14
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'542'394.21	2'013'237.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'721'589.25	3'738'868.99
Total	7'263'983.46	5'752'106.14
Klasse NT CHF		
Nettoertrag	13'492'589.33	10'122'613.16
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	13'492'589.33	10'122'613.16
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'722'406.27	3'542'914.61
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'770'183.06	6'579'698.55
Total	13'492'589.33	10'122'613.16

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							2'446'249'130.95	98.86	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							2'446'249'130.95	98.86	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	0	65'826	5'370	60'456 CHF	113.08%	68'363'644.80	2.76	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	6'295	0	230	6'065 CHF	101.35%	6'146'877.50	0.25	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'225	0	0	3'225 CHF	101.49%	3'273'052.50	0.13	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	7'400	0	970	6'430 CHF	101.60%	6'532'880.00	0.26	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	11'750	0	760	10'990 CHF	101.80%	11'187'820.00	0.45	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'900	0	140	2'760 CHF	101.90%	2'812'440.00	0.11	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	1'100	0	100	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.04	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	10'700	250	1'030	9'920 CHF	103.80%	10'296'960.00	0.42	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'335	110	430	2'015 CHF	103.05%	2'076'457.50	0.08	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	1'330	0	220	1'110 CHF	102.14%	1'133'754.00	0.05	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	5'510	0	650	4'860 CHF	104.00%	5'054'400.00	0.20	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	7'750	0	7'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	6'300	0	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	4'000	250	240	4'010 CHF	106.37%	4'265'437.00	0.17	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	35'300	1'000	1'984	34'316 CHF	108.02%	37'068'143.20	1.50	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	3'250	0	100	3'150 CHF	101.20%	3'187'800.00	0.13	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'750	0	100	1'650 CHF	101.25%	1'670'625.00	0.07	a)
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	2'400	0	100	2'300 CHF	100.92%	2'321'160.00	0.09	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	3'000	0	280	2'720 CHF	101.28%	2'754'816.00	0.11	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	2'905	0	220	2'685 CHF	100.70%	2'703'795.00	0.11	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	0	4'000	200	3'800 CHF	104.20%	3'959'600.00	0.16	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	5'740	0	380	5'360 CHF	100.85%	5'405'560.00	0.22	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	2'010	0	350	1'660 CHF	101.20%	1'679'920.00	0.07	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	2'200	0	100	2'100 CHF	101.80%	2'137'800.00	0.09	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'250	0	390	5'860 CHF	101.03%	5'920'358.00	0.24	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGОВI 2 12/15/28	0	2'500	100	2'400 CHF	104.00%	2'496'000.00	0.10	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	0	7'300	700	6'600 CHF	103.75%	6'847'500.00	0.28	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'200	0	120	1'080 CHF	101.90%	1'100'520.00	0.04	a)
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	5'000	0	300	4'700 CHF	103.52%	4'865'440.00	0.20	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'600	0	100	1'500 CHF	102.10%	1'531'500.00	0.06	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'330	0	160	2'170 CHF	102.25%	2'218'825.00	0.09	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	4'900	0	170	4'730 CHF	102.47%	4'846'831.00	0.20	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	2'600	0	200	2'400 CHF	102.20%	2'452'800.00	0.10	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	37'139	0	37'139	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	4'450	0	240	4'210 CHF	102.20%	4'302'620.00	0.17	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	5'995	0	380	5'615 CHF	104.03%	5'841'284.50	0.24	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	2'900	0	170	2'730 CHF	101.24%	2'763'852.00	0.11	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	1'570	0	0	1'570 CHF	101.40%	1'591'980.00	0.06	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	5'300	500	220	5'580 CHF	101.08%	5'640'264.00	0.23	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'775	0	100	1'675 CHF	100.40%	1'681'700.00	0.07	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	1'000	1'400	100	2'300 CHF	101.00%	2'323'000.00	0.09	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	1'600	100	100	1'600 CHF	100.15%	1'602'400.00	0.06	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	2'300	0	100	2'200 CHF	100.25%	2'205'500.00	0.09	a)
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	5'000	2'000	1'330	5'670 CHF	100.76%	5'713'092.00	0.23	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	3'400	0	3'400	0 CHF	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.
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	7'070	0	7'070	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	3'800	0	500	3'300 CHF	100.30%	3'309'900.00	0.13 a)	
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	3'595	0	250	3'345 CHF	100.95%	3'376'777.50	0.14 a)	
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	9'055	0	290	8'765 CHF	100.19%	8'781'653.50	0.35 a)	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	500	1'700	320	1'880 CHF	99.90%	1'878'120.00	0.08 a)	
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	0	7'600	440	7'160 CHF	101.26%	7'250'216.00	0.29 a)	
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	8'400	1'400	330	9'470 CHF	100.63%	9'529'661.00	0.39 a)	
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	38'950	500	3'250	36'200 CHF	100.63%	36'428'060.00	1.47 a)	
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'500	400	200	2'700 CHF	100.95%	2'725'650.00	0.11 a)	
CH0185577837	1.4500 % KBFRI 1.45 06/07/27	2'200	100	100	2'200 CHF	100.00%	2'200'000.00	0.09 a)	
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'500	120	120	1'500 CHF	100.25%	1'503'750.00	0.06 a)	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185843015	1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'500	0	100	2'400 CHF	100.55%	2'413'200.00	0.10 a)	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	2'000	0	0	2'000 CHF	99.95%	1'999'000.00	0.08 a)	
CH0188335365	1.7500 % SCMNVS 1 3/4 07/10/24	4'750	0	4'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	6'300	0	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	0	2'250	100	2'150 CHF	100.50%	2'160'750.00	0.09 a)	
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	7'800	0	1'670	6'130 CHF	100.22%	6'143'486.00	0.25 a)	
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	0	2'200	600	1'600 CHF	99.95%	1'599'200.00	0.06 a)	
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	3'150	0	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'100	0	100	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.04 a)	
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	2'050	0	300	1'750 CHF	99.60%	1'743'000.00	0.07 a)	
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'000	1'200	210	1'990 CHF	99.80%	1'986'020.00	0.08 a)	
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	3'450	370	3'080 CHF	102.60%	3'160'080.00	0.13 a)	
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	1'570	0	100	1'470 CHF	100.11%	1'471'617.00	0.06 a)	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	0	3'660	130	3'530 CHF	100.25%	3'538'825.00	0.14 a)	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	5'500	4'000	1'140	8'360 CHF	100.23%	8'379'228.00	0.34 a)	
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	0	3'200	870	2'330 CHF	101.00%	2'353'300.00	0.10 a)	
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	0	2'200	250	1'950 CHF	101.10%	1'971'450.00	0.08 a)	
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	3'900	0	100	3'800 CHF	99.74%	3'790'120.00	0.15 a)	
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	500	1'810	0	2'310 CHF	100.25%	2'315'775.00	0.09 a)	
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	0	1'550	100	1'450 CHF	100.80%	1'461'600.00	0.06 a)	
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	2'800	0	225	2'575 CHF	99.82%	2'570'365.00	0.10 a)	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	2'000	0	100	1'900 CHF	100.25%	1'904'750.00	0.08 a)	
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	0	3'500	250	3'250 CHF	101.45%	3'297'125.00	0.13 a)	
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	0	4'000	135	3'865 CHF	100.77%	3'894'760.50	0.16 a)	
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	0	1'510	110	1'400 CHF	102.50%	1'435'000.00	0.06 a)	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	9'400	0	600	8'800 CHF	100.41%	8'836'080.00	0.36 a)	
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	0	2'800	220	2'580 CHF	102.70%	2'649'660.00	0.11 a)	
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'465	0	130	1'335 CHF	101.15%	1'350'352.50	0.05 a)	
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	3'100	400	210	3'290 CHF	100.79%	3'315'991.00	0.13 a)	
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	500	250	110	640 CHF	101.55%	649'920.00	0.03 a)	
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	3'750	0	3'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	43'500	3'550	6'398	40'652 CHF	100.75%	40'956'890.00	1.66 a)	
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	1'100	0	110	990 CHF	100.35%	993'465.00	0.04 a)	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	900	0	100	800 CHF	100.02%	800'160.00	0.03 a)	
CH0228531437	2.3750 % KWLLI 2 3/8 12/10/26	150	1'850	100	1'900 CHF	101.95%	1'937'050.00	0.08 a)	
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	3'600	0	150	3'450 CHF	100.20%	3'456'900.00	0.14 a)	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	7'950	1'500	1'150	8'300 CHF	100.68%	8'356'440.00	0.34 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.
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	3'400	0	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238053125	1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	1'950	0	100	1'850 CHF	100.15%	1'852'775.00	0.07	a)
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	8'850	0	8'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109618	1.8750 % GZOWTZ 1 7/8 06/12/24	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	4'950	1'000	5'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	6'750	0	440	6'310 CHF	100.23%	6'324'513.00	0.26	a)
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	2'450	0	2'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244717978	1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'850	0	210	1'640 CHF	100.35%	1'645'740.00	0.07	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 07/14/26	2'550	500	100	2'950 CHF	100.35%	2'960'325.00	0.12	a)
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	7'900	0	7'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	2'950	0	2'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	12'435	0	12'435	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	700	0	0	700 CHF	99.35%	695'450.00	0.03	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252703050	1.2500 % KWLIL 1 1/4 09/11/24	2'340	0	2'340	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	500	2'750	210	3'040 CHF	99.45%	3'023'280.00	0.12	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	1'680	0	100	1'580 CHF	98.70%	1'559'460.00	0.06	a)
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'400	350	0	2'750 CHF	99.65%	2'740'375.00	0.11	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	10'650	0	10'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'600	500	230	1'870 CHF	99.50%	1'860'650.00	0.08	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	0	2'200	220	1'980 CHF	99.55%	1'971'090.00	0.08	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	4'100	300	180	4'220 CHF	99.25%	4'188'350.00	0.17	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	2'300	0	100	2'200 CHF	97.50%	2'145'000.00	0.09	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	850	0	100	750 CHF	99.81%	748'575.00	0.03	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	9'550	0	9'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	11'050	0	11'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	1'215	0	100	1'115 CHF	99.17%	1'105'745.50	0.04	a)
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	5'700	0	5'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	2'150	0	700	1'450 CHF	99.43%	1'441'735.00	0.06	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'300	0	100	1'200 CHF	99.31%	1'191'720.00	0.05	a)
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	2'715	0	500	2'215 CHF	99.15%	2'196'172.50	0.09	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'205	1'500	150	2'555 CHF	98.00%	2'503'900.00	0.10	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	2'270	0	100	2'170 CHF	99.25%	2'153'725.00	0.09	a)
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	800	100	100	800 CHF	99.49%	795'920.00	0.03	a)
CH0262888941	0.8750 % VBPSW 0 7/8 10/07/24	650	0	650	0 CHF	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.
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	0	10'600	650	9'950 CHF	98.55%	9'805'725.00	0.40	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	11'535	0	1'485	10'050 CHF	98.97%	9'946'485.00	0.40	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	4'700	240	240	4'700 CHF	98.87%	4'646'890.00	0.19	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	750	0	100	650 CHF	98.45%	639'925.00	0.03	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	2'600	0	200	2'400 CHF	97.80%	2'347'200.00	0.09	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'700	0	100	1'600 CHF	98.52%	1'576'320.00	0.06	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	3'000	0	180	2'820 CHF	96.90%	2'732'580.00	0.11	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	1'700	0	0	1'700 CHF	96.85%	1'646'450.00	0.07	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	3'900	0	170	3'730 CHF	96.55%	3'601'315.00	0.15	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	5'500	0	340	5'160 CHF	98.59%	5'087'244.00	0.21	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	3'800	0	600	3'200 CHF	96.95%	3'102'400.00	0.13	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	10'750	0	10'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	0	10'500	630	9'870 CHF	96.66%	9'540'342.00	0.39	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	1'610	0	100	1'510 CHF	98.74%	1'490'974.00	0.06	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	2'500	0	0	2'500 CHF	97.10%	2'427'500.00	0.10	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	1'250	0	0	1'250 CHF	99.25%	1'240'625.00	0.05	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	11'750	1'000	1'720	11'030 CHF	98.77%	10'894'331.00	0.44	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	2'450	100	100	2'450 CHF	97.45%	2'387'525.00	0.10	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	0	3'000	100	2'900 CHF	97.20%	2'818'800.00	0.11	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	2'400	0	120	2'280 CHF	99.50%	2'268'600.00	0.09	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	3'000	0	0	3'000 CHF	98.59%	2'957'700.00	0.12	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	0	2'870	320	2'550 CHF	96.70%	2'465'850.00	0.10	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	1'925	0	100	1'825 CHF	98.13%	1'790'872.50	0.07	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'600	0	100	1'500 CHF	98.40%	1'476'000.00	0.06	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	10'200	0	10'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'650	0	0	1'650 CHF	98.26%	1'621'290.00	0.07	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	1'250	120	120	1'250 CHF	98.36%	1'229'500.00	0.05	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'000	0	100	900 CHF	98.62%	887'580.00	0.04	a)
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'640	0	100	1'540 CHF	99.35%	1'529'990.00	0.06	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	1'410	0	910	500 CHF	99.83%	499'150.00	0.02	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	4'550	700	200	5'050 CHF	98.53%	4'975'765.00	0.20	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	4'000	0	230	3'770 CHF	98.53%	3'714'581.00	0.15	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	9'280	0	430	8'850 CHF	98.94%	8'756'190.00	0.35	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	2'350	0	110	2'240 CHF	98.65%	2'209'760.00	0.09	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	600	1'500	500	1'600 CHF	98.20%	1'571'200.00	0.06	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	12'700	0	860	11'840 CHF	97.75%	11'573'600.00	0.47	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	2'200	0	0	2'200 CHF	98.67%	2'170'740.00	0.09	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	10'700	0	660	10'040 CHF	98.64%	9'903'456.00	0.40	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'350	0	100	1'250 CHF	98.65%	1'233'125.00	0.05	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	7'800	0	520	7'280 CHF	98.08%	7'140'224.00	0.29	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	0	5'750	400	5'350 CHF	98.00%	5'243'000.00	0.21	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'300	0	100	1'200 CHF	100.25%	1'203'000.00	0.05	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	1'900	0	0	1'900 CHF	98.15%	1'864'850.00	0.08	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	6'500	0	350	6'150 CHF	98.32%	6'046'680.00	0.24	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	9'750	0	1'520	8'230 CHF	98.27%	8'087'621.00	0.33	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	2'500	670	1'830 CHF	99.20%	1'815'360.00	0.07	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	3'950	0	210	3'740 CHF	98.20%	3'672'680.00	0.15	a)
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	7'700	0	7'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	3'050	0	230	2'820 CHF	97.75%	2'756'550.00	0.11	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	4'650	0	4'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'850	0	340	1'510 CHF	97.80%	1'476'780.00	0.06	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'000	1'850	220	2'630 CHF	96.45%	2'536'635.00	0.10	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'500	0	400	2'100 CHF	97.25%	2'042'250.00	0.08	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	3'650	0	250	3'400 CHF	97.45%	3'313'300.00	0.13	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.
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	0	1'000	510	490 CHF	99.05%	485'345.00	0.02	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	1'200	0	120	1'080 CHF	95.90%	1'035'720.00	0.04	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	5'650	500	300	5'850 CHF	97.49%	5'703'165.00	0.23	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	2'100	0	500	1'600 CHF	99.10%	1'585'600.00	0.06	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	3'065	100	100	3'065 CHF	100.45%	3'078'792.50	0.12	a)
CH0306770600	0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	0	11'550	425	11'125 CHF	95.83%	10'661'087.50	0.43	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	10'050	700	610	10'140 CHF	97.38%	9'874'332.00	0.40	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	97.40%	1'558'400.00	0.06	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	1'400	0	200	1'200 CHF	99.05%	1'188'600.00	0.05	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRI 0 1/2 02/23/28	0	2'730	780	1'950 CHF	96.05%	1'872'975.00	0.08	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0311427618	0.2000 % WKBSNW 0.2 08/19/24	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	0	1'000	220	780 CHF	95.30%	743'340.00	0.03	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	3'500	0	0	3'500 CHF	98.57%	3'449'950.00	0.14	a)
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	1'950	0	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'700	0	200	1'500 CHF	97.50%	1'462'500.00	0.06	a)
CH0315593860	0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN	1'055	0	1'055	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	680	0	0	680 CHF	96.20%	654'160.00	0.03	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMN 0 3/8 03/31/28	0	2'000	810	1'190 CHF	96.25%	1'145'375.00	0.05	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	9'500	1'000	455	10'045 CHF	96.60%	9'703'470.00	0.39	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	4'510	150	850	3'810 CHF	96.95%	3'693'795.00	0.15	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDK 0 1/4 05/27/26	1'700	0	100	1'600 CHF	97.00%	1'552'000.00	0.06	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'650	0	200	1'450 CHF	97.25%	1'410'125.00	0.06	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	10'400	700	9'700 CHF	94.71%	9'186'870.00	0.37	a)
CH0319415953	0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	2'490	0	590	1'900 CHF	98.35%	1'868'650.00	0.08	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	4'320	310	1'010	3'620 CHF	97.50%	3'529'500.00	0.14	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'900	0	100	1'800 CHF	96.95%	1'745'100.00	0.07	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	0	250	0	250 CHF	96.30%	240'750.00	0.01	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	3'780	0	200	3'580 CHF	98.29%	3'518'782.00	0.14	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	6'600	0	6'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	7'700	200	1'515	6'385 CHF	95.56%	6'101'506.00	0.25	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'165	0	0	1'165 CHF	96.85%	1'128'302.50	0.05	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	3'900	0	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	1'050	0	230	820 CHF	97.70%	801'140.00	0.03	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	3'300	130	130	3'300 CHF	97.90%	3'230'700.00	0.13	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	3'550	0	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	5'300	0	690	4'610 CHF	95.10%	4'384'110.00	0.18	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	1'100	0	100	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.04	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	300	600	110	790 CHF	97.05%	766'695.00	0.03	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	750	0	100	650 CHF	96.60%	627'900.00	0.03	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	8'750	0	8'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	9'500	0	535	8'965 CHF	96.19%	8'623'433.50	0.35	a)
CH033645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	2'600	0	120	2'480 CHF	98.00%	2'430'400.00	0.10	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	6'800	0	1'365	5'435 CHF	96.58%	5'249'123.00	0.21	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	3'450	0	160	3'290 CHF	96.50%	3'174'850.00	0.13	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	4'720	0	4'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	1'300	0	200	1'100 CHF	97.00%	1'067'000.00	0.04	a)
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	3'300	250	230	3'320 CHF	96.20%	3'193'840.00	0.13	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	9'100	0	545	8'555 CHF	98.47%	8'424'108.50	0.34	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	10'000	1'000	11'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	0	5'000	470	4'530 CHF	95.75%	4'337'475.00	0.18	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'750	0	100	1'650 CHF	96.35%	1'589'775.00	0.06	a)
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0346461772	0.3500 % BSANCI 0.35 05/30/25 EMTN	395	0	395	0 CHF	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.
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	2'625	0	540	2'085 CHF	97.75%	2'038'087.50	0.08	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	3'400	0	240	3'160 CHF	97.70%	3'087'320.00	0.12	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRI 0.3 02/17/27	2'700	120	320	2'500 CHF	96.60%	2'415'000.00	0.10	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	1'000	1'350	0	2'350 CHF	96.35%	2'264'225.00	0.09	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'950	0	500	2'450 CHF	97.50%	2'388'750.00	0.10	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	10'800	0	520	10'280 CHF	98.28%	10'103'184.00	0.41	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	7'200	830	6'370 CHF	96.26%	6'131'762.00	0.25	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	1'950	0	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0350030422	0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26	1'800	0	100	1'700 CHF	98.10%	1'667'700.00	0.07	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBSNW 0.2 02/02/26	2'450	0	0	2'450 CHF	97.35%	2'385'075.00	0.10	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	1'000	7'750	550	8'200 CHF	96.71%	7'930'220.00	0.32	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	3'200	0	530	2'670 CHF	97.80%	2'611'260.00	0.11	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	0	2'500	0	2'500 CHF	95.80%	2'395'000.00	0.10	a)
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	2'500	1'450	0	3'950 CHF	96.25%	3'801'875.00	0.15	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	2'950	0	2'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	3'400	0	100	3'300 CHF	97.10%	3'204'300.00	0.13	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'700	0	700	2'000 CHF	97.75%	1'955'000.00	0.08	a)
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	1'650	0	110	1'540 CHF	98.62%	1'518'748.00	0.06	a)
CH0357483160	2.0000 % KWLLI 2 12/11/23	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	1'300	0	450	850 CHF	97.30%	827'050.00	0.03	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNX 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'800	1'500	130	3'170 CHF	97.80%	3'100'260.00	0.13	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	2'800	0	110	2'690 CHF	97.45%	2'621'405.00	0.11	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	1'000	100	100	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.04	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	7'750	0	7'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	9'700	0	570	9'130 CHF	97.41%	8'893'533.00	0.36	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	900	0	0	900 CHF	97.65%	878'850.00	0.04	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	11'100	0	11'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	4'000	0	4'000 CHF	96.10%	3'844'000.00	0.16	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	4'350	0	1'400	2'950 CHF	98.05%	2'892'475.00	0.12	a)
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	12'860	0	490	12'370 CHF	96.95%	11'992'715.00	0.48	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	2'980	250	2'730 CHF	96.60%	2'637'180.00	0.11	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	3'800	0	1'010	2'790 CHF	98.05%	2'735'595.00	0.11	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	9'800	400	820	9'380 CHF	96.56%	9'057'328.00	0.37	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	3'205	0	3'205	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	7'100	500	845	6'755 CHF	97.59%	6'592'204.50	0.27	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	8'200	0	940	7'260 CHF	97.96%	7'111'896.00	0.29	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	0	800	120	680 CHF	96.55%	656'540.00	0.03	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	4'100	0	0	4'100 CHF	98.29%	4'029'890.00	0.16	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	0	750	120	630 CHF	95.40%	601'020.00	0.02	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	8'690	0	8'690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748359	0.3750 % SCMNVX 0 3/8 05/31/27	850	0	290	560 CHF	97.00%	543'200.00	0.02	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	3'400	0	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501508	0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	3'000	1'650	0	4'650 CHF	97.95%	4'554'675.00	0.18	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	850	1'200	100	1'950 CHF	98.50%	1'920'750.00	0.08	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	2'000	0	100	1'900 CHF	97.98%	1'861'620.00	0.08	a)
CH0367206742	0.7000 % LONNVX 0.7 07/12/24	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'600	1'000	200	2'400 CHF	95.90%	2'301'600.00	0.09	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	0	1'500	300	1'200 CHF	97.70%	1'172'400.00	0.05	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'800	0	200	2'600 CHF	97.85%	2'544'100.00	0.10	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	4'190	0	1'610	2'580 CHF	97.91%	2'526'078.00	0.10	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	7'400	0	330	7'070 CHF	97.19%	6'871'333.00	0.28	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	850	0	100	750 CHF	98.05%	735'375.00	0.03	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	0	10'000	1'275	8'725 CHF	95.94%	8'370'765.00	0.34	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	0	1'050	0	1'050 CHF	97.75%	1'026'375.00	0.04	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	8'000	3'500	1'080	10'420 CHF	96.06%	10'009'452.00	0.40	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.
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	850	130	130	850 CHF	97.70%	830'450.00	0.03	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'800	750	620	3'930 CHF	95.80%	3'764'940.00	0.15	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	0	11'300	1'210	10'090 CHF	96.63%	9'749'967.00	0.39	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	2'140	0	100	2'040 CHF	97.65%	1'992'060.00	0.08	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	4'540	0	120	4'420 CHF	98.42%	4'350'164.00	0.18	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	0	9'500	350	9'150 CHF	96.20%	8'802'300.00	0.36	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476784	0.5000 % KBSh 0 1/2 05/31/28	0	220	0	220 CHF	96.10%	211'420.00	0.01	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	2'775	220	220	2'775 CHF	98.70%	2'738'925.00	0.11	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'650	0	500	1'150 CHF	98.22%	1'129'530.00	0.05	a)
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	1'180	0	100	1'080 CHF	98.85%	1'067'580.00	0.04	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	1'200	0	110	1'090 CHF	96.35%	1'050'215.00	0.04	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	3'900	0	210	3'690 CHF	97.67%	3'604'023.00	0.15	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	3'000	7'200	1'320	8'880 CHF	96.20%	8'542'560.00	0.35	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	3'450	0	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	0	1'000	150	850 CHF	96.10%	816'850.00	0.03	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	0	1'900	110	1'790 CHF	95.40%	1'707'660.00	0.07	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'100	0	100	1'000 CHF	97.65%	976'500.00	0.04	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	2'700	220	220	2'700 CHF	97.10%	2'621'700.00	0.11	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'050	0	100	950 CHF	98.10%	931'950.00	0.04	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	96.40%	5'784'000.00	0.23	a)
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	7'000	500	440	7'060 CHF	97.27%	6'867'262.00	0.28	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'650	0	240	2'410 CHF	98.45%	2'372'645.00	0.10	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'790	0	300	4'490 CHF	97.20%	4'364'280.00	0.18	a)
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	1'000	2'000	200	2'800 CHF	96.35%	2'697'800.00	0.11	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'000	3'900	230	4'670 CHF	96.55%	4'508'885.00	0.18	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'700	0	100	2'600 CHF	97.80%	2'542'800.00	0.10	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	900	0	100	800 CHF	97.50%	780'000.00	0.03	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'000	500	110	1'390 CHF	95.85%	1'332'315.00	0.05	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	150	150	0	300 CHF	96.80%	290'400.00	0.01	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	1'900	100	100	1'900 CHF	97.60%	1'854'400.00	0.07	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	2'855	100	1'100	1'855 CHF	99.70%	1'849'435.00	0.07	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'700	200	230	2'670 CHF	95.50%	2'549'850.00	0.10	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	7'550	250	530	7'270 CHF	97.63%	7'097'701.00	0.29	a)
CH0392885791	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 08/07/24	1'400	1'000	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	0	500	130	370 CHF	95.40%	352'980.00	0.01	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	2'545	0	410	2'135 CHF	97.95%	2'091'232.50	0.08	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'150	0	290	860 CHF	96.50%	829'900.00	0.03	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	3'550	0	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	5'100	0	265	4'835 CHF	98.34%	4'754'739.00	0.19	a)
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	1'000	700	0	1'700 CHF	96.15%	1'634'550.00	0.07	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	2'600	0	100	2'500 CHF	97.05%	2'426'250.00	0.10	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	350	0	0	350 CHF	96.70%	338'450.00	0.01	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	0	1'325	420	905 CHF	95.70%	866'085.00	0.04	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	2'100	250	120	2'230 CHF	97.42%	2'172'466.00	0.09	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	2'900	0	720	2'180 CHF	98.25%	2'141'850.00	0.09	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	500	140	360 CHF	98.05%	352'980.00	0.01	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	5'800	0	5'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.04	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'750	600	250	3'100 CHF	96.30%	2'985'300.00	0.12	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	2'400	0	350	2'050 CHF	97.15%	1'991'575.00	0.08	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	3'260	0	3'260	0 CHF	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.
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	1'830	0	1'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	0	1'650	470	1'180 CHF	95.90%	1'131'620.00	0.05	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	95.65%	1'913'000.00	0.08	a)
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	2'270	100	100	2'270 CHF	97.35%	2'209'845.00	0.09	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	5'600	0	0	5'600 CHF	96.80%	5'420'800.00	0.22	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	3'650	0	3'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	1'100	250	100	1'250 CHF	95.00%	1'187'500.00	0.05	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	2'500	0	500	2'000 CHF	97.80%	1'956'000.00	0.08	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	600	0	0	600 CHF	98.70%	592'200.00	0.02	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	0	1'000	300	700 CHF	96.70%	676'900.00	0.03	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	2'550	120	120	2'550 CHF	98.42%	2'509'710.00	0.10	a)
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	14'335	0	14'335	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	850	0	100	750 CHF	98.34%	737'550.00	0.03	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	2'100	0	100	2'000 CHF	97.30%	1'946'000.00	0.08	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	1'115	0	100	1'015 CHF	98.25%	997'237.50	0.04	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	97.65%	2'929'500.00	0.12	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	1'250	0	100	1'150 CHF	98.34%	1'130'910.00	0.05	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	2'800	0	130	2'670 CHF	98.50%	2'629'950.00	0.11	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'350	0	100	2'250 CHF	98.65%	2'219'625.00	0.09	a)
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	5'650	0	5'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	3'400	0	610	2'790 CHF	98.14%	2'738'106.00	0.11	a)
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	0	1'600	100	1'500 CHF	97.15%	1'457'250.00	0.06	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	2'200	0	200	2'000 CHF	98.40%	1'968'000.00	0.08	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	3'350	0	3'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	3'400	0	250	3'150 CHF	98.80%	3'112'200.00	0.13	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	0	5'025	220	4'805 CHF	96.40%	4'632'020.00	0.19	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'500	0	125	1'375 CHF	98.96%	1'360'700.00	0.05	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	1'000	500	500	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.04	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBSW 0.3 02/01/27	1'400	0	0	1'400 CHF	96.50%	1'351'000.00	0.05	a)
CH0419040750	0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	2'000	0	100	1'900 CHF	99.76%	1'895'440.00	0.08	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	4'600	1'000	220	5'380 CHF	96.05%	5'167'490.00	0.21	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	2'000	700	140	2'560 CHF	97.45%	2'494'720.00	0.10	a)
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	1'300	1'500	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040875	0.1250 % KOWEPW 0 1/8 02/27/24 EMTN	1'570	0	1'570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040982	0.5000 % SCMNVX 0 1/2 03/15/29	0	3'000	120	2'880 CHF	95.90%	2'761'920.00	0.11	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	4'300	0	250	4'050 CHF	98.30%	3'981'150.00	0.16	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	4'550	0	600	3'950 CHF	96.05%	3'793'975.00	0.15	a)
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'400	0	100	1'300 CHF	97.45%	1'266'850.00	0.05	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	2'000	0	500	1'500 CHF	96.80%	1'452'000.00	0.06	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.10%	1'922'000.00	0.08	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	2'850	1'190	120	3'920 CHF	97.98%	3'840'816.00	0.16	a)
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	1'700	0	100	1'600 CHF	96.55%	1'544'800.00	0.06	a)
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	0	2'740	200	2'540 CHF	96.00%	2'438'400.00	0.10	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	6'600	0	350	6'250 CHF	96.05%	6'003'125.00	0.24	a)
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	1'950	0	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	1'000	0	100	900 CHF	94.95%	854'550.00	0.03	a)
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	0	1'100	110	990 CHF	92.25%	913'275.00	0.04	a)
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	3'700	0	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	0	2'400	200	2'200 CHF	94.80%	2'085'600.00	0.08	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'950	0	100	1'850 CHF	95.75%	1'771'375.00	0.07	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.
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	2'000	0	150	1'850 CHF	97.20%	1'798'200.00	0.07	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	2'200	0	900	1'300 CHF	98.00%	1'274'000.00	0.05	a)
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	9'080	0	9'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	3'600	0	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	8'450	0	425	8'025 CHF	97.99%	7'863'697.50	0.32	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'300	0	100	1'200 CHF	97.35%	1'168'200.00	0.05	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	0	4'000	300	3'700 CHF	96.65%	3'576'050.00	0.14	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	1'400	0	100	1'300 CHF	98.59%	1'281'670.00	0.05	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	1'950	0	1'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	2'350	0	160	2'190 CHF	97.60%	2'137'440.00	0.09	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	2'000	1'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	0	10'400	600	9'800 CHF	96.01%	9'408'980.00	0.38	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	1'700	0	100	1'600 CHF	98.25%	1'572'000.00	0.06	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	4'650	0	280	4'370 CHF	99.09%	4'330'233.00	0.18	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	4'000	0	2'000	2'000 CHF	99.29%	1'985'800.00	0.08	a)
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	3'500	310	660	3'150 CHF	98.20%	3'093'300.00	0.13	a)
CH0434678352	1.1250 % BOBST 1 1/8 09/27/24	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'260	0	100	1'160 CHF	97.90%	1'135'640.00	0.05	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	0	5'800	350	5'450 CHF	96.87%	5'279'415.00	0.21	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'450	3'000	5'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	2'200	0	140	2'060 CHF	98.65%	2'032'190.00	0.08	a)
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0437180935	0.7500 % SCMNXX 0 3/4 10/12/28	0	1'600	430	1'170 CHF	97.35%	1'138'995.00	0.05	a)
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	1'175	0	1'175	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	350	800	200	950 CHF	98.30%	933'850.00	0.04	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	1'400	100	100	1'400 CHF	97.70%	1'367'800.00	0.06	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	8'550	0	460	8'090 CHF	97.04%	7'850'536.00	0.32	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'775	0	630	8'145 CHF	97.70%	7'957'665.00	0.32	a)
CH0441186522	0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	600	0	0	600 CHF	97.40%	584'400.00	0.02	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	0	850	100	750 CHF	96.55%	724'125.00	0.03	a)
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	2'310	0	100	2'210 CHF	98.95%	2'186'795.00	0.09	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	2'700	0	200	2'500 CHF	97.45%	2'436'250.00	0.10	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	6'000	0	930	5'070 CHF	97.11%	4'923'477.00	0.20	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	2'650	0	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206800	0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24	2'770	0	2'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	0	1'250	350	900 CHF	95.80%	862'200.00	0.03	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	5'650	0	250	5'400 CHF	96.55%	5'213'700.00	0.21	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	1'750	130	130	1'750 CHF	98.05%	1'715'875.00	0.07	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	4'800	1'000	5'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'200	100	100	1'200 CHF	97.35%	1'168'200.00	0.05	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	2'680	100	700	2'080 CHF	93.85%	1'952'080.00	0.08	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	2'310	0	2'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	4'750	0	0	4'750 CHF	96.30%	4'574'250.00	0.18	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	3'200	0	210	2'990 CHF	97.91%	2'927'509.00	0.12	a)
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	0	2'100	100	2'000 CHF	95.00%	1'900'000.00	0.08	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	1'000	400	0	1'400 CHF	94.90%	1'328'600.00	0.05	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	4'700	190	4'510 CHF	93.00%	4'194'300.00	0.17	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	0	1'600	360	1'240 CHF	93.80%	1'163'120.00	0.05	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	1'530	0	1'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	0	2'900	140	2'760 CHF	97.80%	2'699'280.00	0.11	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	0	1'000	360	640 CHF	95.20%	609'280.00	0.02	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.
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	1'400	0	200	1'200 CHF	98.55%	1'182'600.00	0.05	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	3'200	0	140	3'060 CHF	98.00%	2'998'800.00	0.12	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'300	0	200	2'100 CHF	96.60%	2'028'600.00	0.08	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	2'250	0	360	1'890 CHF	98.10%	1'854'090.00	0.07	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	4'435	0	1'680	2'755 CHF	97.31%	2'680'890.50	0.11	a)
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	1'670	0	110	1'560 CHF	97.55%	1'521'780.00	0.06	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	1'300	0	100	1'200 CHF	98.60%	1'183'200.00	0.05	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	6'225	0	6'225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	1'000	100	900 CHF	95.55%	859'950.00	0.03	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'450	0	110	1'340 CHF	98.23%	1'316'282.00	0.05	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	870	0	870	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474178420	0.1250 % RAIFFS 0 1/8 05/07/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	1'760	0	1'760	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'810	100	100	1'810 CHF	96.85%	1'752'985.00	0.07	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	4'050	150	270	3'930 CHF	96.75%	3'802'275.00	0.15	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	1'200	100	100	1'200 CHF	97.90%	1'174'800.00	0.05	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'130	0	0	1'130 CHF	97.40%	1'100'620.00	0.04	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	2'870	0	1'340	1'530 CHF	97.73%	1'495'269.00	0.06	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'750	0	120	1'630 CHF	97.56%	1'590'228.00	0.06	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	1'850	0	100	1'750 CHF	96.65%	1'691'375.00	0.07	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	2'200	400	1'800 CHF	94.50%	1'701'000.00	0.07	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	1'500	0	100	1'400 CHF	98.00%	1'372'000.00	0.06	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	250	2'200	220	2'230 CHF	95.15%	2'121'845.00	0.09	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	250	2'250	320	2'180 CHF	95.20%	2'075'360.00	0.08	a)
CH0482172415	0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	2'400	0	100	2'300 CHF	98.01%	2'254'230.00	0.09	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	4'700	0	280	4'420 CHF	97.60%	4'313'920.00	0.17	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	0	2'000	200	1'800 CHF	94.15%	1'694'700.00	0.07	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	7'000	0	410	6'590 CHF	95.72%	6'307'948.00	0.25	a)
CH0485445958	0.0000 % KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'590	0	2'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	2'000	0	100	1'900 CHF	92.30%	1'753'700.00	0.07	a)
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	2'950	0	200	2'750 CHF	97.75%	2'688'125.00	0.11	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	500	750	100	1'150 CHF	95.85%	1'102'275.00	0.04	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	3'250	0	695	2'555 CHF	97.70%	2'496'235.00	0.10	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	800	0	130	670 CHF	96.70%	647'890.00	0.03	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	500	700	100	1'100 CHF	95.90%	1'054'900.00	0.04	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'725	0	160	3'565 CHF	96.05%	3'424'182.50	0.14	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	95.95%	1'535'200.00	0.06	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	5'850	0	300	5'550 CHF	97.17%	5'392'935.00	0.22	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	1'650	0	0	1'650 CHF	95.55%	1'576'575.00	0.06	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	930	0	100	830 CHF	96.90%	804'270.00	0.03	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	3'000	1'700	190	4'510 CHF	94.20%	4'248'420.00	0.17	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'150	100	100	1'150 CHF	96.75%	1'112'625.00	0.04	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	0	2'300	410	1'890 CHF	94.50%	1'786'050.00	0.07	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	0	3'500	0	3'500 CHF	93.75%	3'281'250.00	0.13	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	0	2'000	300	1'700 CHF	96.00%	1'632'000.00	0.07	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	2'000	200	200	2'000 CHF	93.15%	1'863'000.00	0.08	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	0	2'550	220	2'330 CHF	93.65%	2'182'045.00	0.09	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'710	100	100	1'710 CHF	94.70%	1'619'370.00	0.07	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	96.75%	1'161'000.00	0.05	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	3'100	1'500	300	4'300 CHF	96.75%	4'160'250.00	0.17	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	2'000	0	100	1'900 CHF	97.86%	1'859'340.00	0.08	a)
CH0508785737	0.1500 % SANSFC 0.15 12/10/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	3'400	700	260	3'840 CHF	95.96%	3'684'864.00	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.
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	0	4'300	160	4'140 CHF	90.70%	3'754'980.00	0.15	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	0	1'300	100	1'200 CHF	92.95%	1'115'400.00	0.05	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	3'450	0	0	3'450 CHF	98.25%	3'389'625.00	0.14	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'600	0	400	2'200 CHF	97.00%	2'134'000.00	0.09	a)
CH0519465170	0.1250 % AMALEA 0 1/8 02/12/24	280	0	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	4'000	0	1'800	2'200 CHF	98.64%	2'170'080.00	0.09	a)
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	2'050	400	0	2'450 CHF	96.40%	2'361'800.00	0.10	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	5'150	0	1'240	3'910 CHF	97.47%	3'811'077.00	0.15	a)
CH0520663664	0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'800	0	200	2'600 CHF	94.55%	2'458'300.00	0.10	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	0	400	0	400 CHF	92.40%	369'600.00	0.01	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	2'210	0	0	2'210 CHF	95.75%	2'116'075.00	0.09	a)
CH0522158994	0.0100 % KBL 0.01 07/28/26	3'000	0	800	2'200 CHF	96.45%	2'121'900.00	0.09	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	1'800	100	700	1'200 CHF	100.10%	1'201'200.00	0.05	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'000	200	0	2'200 CHF	95.85%	2'108'700.00	0.09	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	0	8'050	495	7'555 CHF	94.84%	7'165'162.00	0.29	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	1'900	0	100	1'800 CHF	97.00%	1'746'000.00	0.07	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	0	1'250	310	940 CHF	96.15%	903'810.00	0.04	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	4'225	800	790	4'235 CHF	98.25%	4'160'887.50	0.17	a)
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	3'355	0	3'355	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	5'050	0	5'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	0	4'750	520	4'230 CHF	95.10%	4'022'730.00	0.16	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	2'200	0	100	2'100 CHF	97.90%	2'055'900.00	0.08	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	0	6'500	320	6'180 CHF	94.43%	5'835'774.00	0.24	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	1'900	0	1'900 CHF	94.70%	1'799'300.00	0.07	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	5'000	850	280	5'570 CHF	95.95%	5'344'415.00	0.22	a)
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	4'605	0	2'510	2'095 CHF	98.90%	2'071'955.00	0.08	a)
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	0	2'300	460	1'840 CHF	96.40%	1'773'760.00	0.07	a)
CH0539032877	1.0000 % LONNVX 1 04/28/23	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	0	8'000	1'160	6'840 CHF	95.01%	6'498'684.00	0.26	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	3'000	0	700	2'300 CHF	98.60%	2'267'800.00	0.09	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	4'800	0	1'640	3'160 CHF	98.42%	3'110'072.00	0.13	a)
CH0541537996	0.2725 % HENKEL 0.2725 04/28/23 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	500	2'700	450	2'750 CHF	98.60%	2'711'500.00	0.11	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	1'200	1'500	1'600	1'100 CHF	98.69%	1'085'590.00	0.04	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	1'220	120	1'100 CHF	96.65%	1'063'150.00	0.04	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'550	0	120	1'430 CHF	96.60%	1'381'380.00	0.06	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	0	1'000	120	880 CHF	94.25%	829'400.00	0.03	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	2'000	0	100	1'900 CHF	97.90%	1'860'100.00	0.08	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	2'300	0	100	2'200 CHF	98.35%	2'163'700.00	0.09	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	4'500	300	4'200 CHF	96.35%	4'046'700.00	0.16	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'900	0	100	1'800 CHF	97.78%	1'760'040.00	0.07	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	2'120	0	100	2'020 CHF	98.02%	1'980'004.00	0.08	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	0	4'500	200	4'300 CHF	94.30%	4'054'900.00	0.16	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	2'200	0	200	2'000 CHF	96.40%	1'928'000.00	0.08	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	2'100	0	300	1'800 CHF	98.30%	1'769'400.00	0.07	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'550	0	210	3'340 CHF	98.60%	3'293'240.00	0.13	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	2'650	100	0	2'750 CHF	96.25%	2'646'875.00	0.11	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	4'785	1'500	100	6'185 CHF	98.00%	6'061'300.00	0.24	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	2'350	0	120	2'230 CHF	95.45%	2'128'535.00	0.09	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	500	0	100	400 CHF	98.44%	393'760.00	0.02	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	0	3'400	620	2'780 CHF	93.05%	2'586'790.00	0.10	a)
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	2'150	0	680	1'470 CHF	97.60%	1'434'720.00	0.06	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	0	2'000	120	1'880 CHF	92.85%	1'745'580.00	0.07	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	800	1'000	100	1'700 CHF	96.85%	1'646'450.00	0.07	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.
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	2'700	1'200	1'600	2'300 CHF	97.10%	2'233'300.00	0.09	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	0	2'750	160	2'590 CHF	93.30%	2'416'470.00	0.10	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	2'060	0	0	2'060 CHF	97.20%	2'002'320.00	0.08	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	2'000	1'400	0	3'400 CHF	94.80%	3'223'200.00	0.13	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	3'000	0	140	2'860 CHF	97.83%	2'797'938.00	0.11	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	4'100	0	1'200	2'900 CHF	97.95%	2'840'550.00	0.11	a)
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'800	700	200	2'300 CHF	94.00%	2'162'000.00	0.09	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	500	750	500	750 CHF	96.70%	725'250.00	0.03	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	3'050	0	0	3'050 CHF	95.00%	2'897'500.00	0.12	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	0	1'250	440	810 CHF	94.35%	764'235.00	0.03	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'100	0	0	1'100 CHF	97.96%	1'077'560.00	0.04	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	1'900	0	100	1'800 CHF	95.45%	1'718'100.00	0.07	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	94.45%	944'500.00	0.04	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	1'600	0	350	1'250 CHF	95.30%	1'191'250.00	0.05	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'600	200	200	1'600 CHF	93.30%	1'492'800.00	0.06	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	0	2'380	130	2'250 CHF	91.25%	2'053'125.00	0.08	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	3'910	180	180	3'910 CHF	94.40%	3'691'040.00	0.15	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'655	0	0	1'655 CHF	94.45%	1'563'147.50	0.06	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	94.50%	1'512'000.00	0.06	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	2'600	0	2'600 CHF	92.05%	2'393'300.00	0.10	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	1'700	0	120	1'580 CHF	97.25%	1'536'550.00	0.06	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	0	11'000	1'070	9'930 CHF	94.78%	9'411'654.00	0.38	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	0	3'350	220	3'130 CHF	92.90%	2'907'770.00	0.12	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	600	250	100	750 CHF	95.05%	712'875.00	0.03	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	550	1'370	250	1'670 CHF	95.90%	1'601'530.00	0.06	a)
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	1'400	0	100	1'300 CHF	97.75%	1'270'750.00	0.05	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	3'900	0	3'900 CHF	94.40%	3'681'600.00	0.15	a)
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	1'500	300	1'200 CHF	93.70%	1'124'400.00	0.05	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	900	200	0	1'100 CHF	96.35%	1'059'850.00	0.04	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	1'000	100	900 CHF	93.35%	840'150.00	0.03	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'325	0	0	1'325 CHF	96.05%	1'272'662.50	0.05	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	5'900	220	5'680 CHF	94.10%	5'344'880.00	0.22	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	0	5'320	400	4'920 CHF	93.90%	4'619'880.00	0.19	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	0	1'865	300	1'565 CHF	93.90%	1'469'535.00	0.06	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	4'200	0	800	3'400 CHF	95.30%	3'240'200.00	0.13	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	3'410	0	0	3'410 CHF	93.50%	3'188'350.00	0.13	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'450	220	480	2'190 CHF	96.15%	2'105'685.00	0.09	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	1'500	100	100	1'500 CHF	96.50%	1'447'500.00	0.06	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	3'800	0	200	3'600 CHF	95.00%	3'420'000.00	0.14	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'000	0	0	2'000 CHF	93.75%	1'875'000.00	0.08	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	93.00%	1'395'000.00	0.06	a)
CH1118483663	0.3500 % SWICC 2021-1 A	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	3'600	160	3'440 CHF	93.85%	3'228'440.00	0.13	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	0	4'000	100	3'900 CHF	93.50%	3'646'500.00	0.15	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	2'900	100	600	2'400 CHF	94.80%	2'275'200.00	0.09	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	3'500	0	200	3'300 CHF	95.05%	3'136'650.00	0.13	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	2'500	300	700	2'100 CHF	95.19%	1'998'990.00	0.08	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'600	600	200	3'000 CHF	94.50%	2'835'000.00	0.11	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	500	0	100	400 CHF	95.25%	381'000.00	0.02	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	0	2'500	220	2'280 CHF	91.75%	2'091'900.00	0.08	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	2'150	0	100	2'050 CHF	97.10%	1'990'550.00	0.08	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'210	0	100	1'110 CHF	97.35%	1'080'585.00	0.04	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	2'085	0	100	1'985 CHF	96.50%	1'915'525.00	0.08	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	0	1'750	0	1'750 CHF	93.70%	1'639'750.00	0.07	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.
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	92.30%	1'292'200.00	0.05	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	94.40%	2'643'200.00	0.11	a)
CH1137122755	0.0500 % TECN SW 0.05 10/06/25	1'625	0	100	1'525 CHF	97.40%	1'485'350.00	0.06	a)
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	1'000	100	900 CHF	93.50%	841'500.00	0.03	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	0	4'280	300	3'980 CHF	92.50%	3'681'500.00	0.15	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	2'090	0	100	1'990 CHF	94.65%	1'883'535.00	0.08	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	2'000	150	1'850 CHF	93.05%	1'721'425.00	0.07	a)
CH1139995778	0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	2'500	0	120	2'380 CHF	96.50%	2'296'700.00	0.09	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	2'740	0	600	2'140 CHF	94.70%	2'026'580.00	0.08	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	4'050	0	210	3'840 CHF	96.35%	3'699'840.00	0.15	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	0	2'200	0	2'200 CHF	93.75%	2'062'500.00	0.08	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'315	0	100	3'215 CHF	97.88%	3'146'842.00	0.13	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	4'100	2'200	1'660	4'640 CHF	95.55%	4'433'520.00	0.18	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	3'350	0	0	3'350 CHF	94.85%	3'177'475.00	0.13	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	4'725	100	1'100	3'725 CHF	95.10%	3'542'475.00	0.14	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	3'000	0	200	2'800 CHF	94.70%	2'651'600.00	0.11	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	3'000	1'500	0	4'500 CHF	95.35%	4'290'750.00	0.17	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	0	2'500	220	2'280 CHF	93.40%	2'129'520.00	0.09	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	0	3'000	100	2'900 CHF	92.60%	2'685'400.00	0.11	a)
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	2'300	0	100	2'200 CHF	96.05%	2'113'100.00	0.09	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	4'200	0	200	4'000 CHF	94.75%	3'790'000.00	0.15	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	3'000	2'600	600	5'000 CHF	93.80%	4'690'000.00	0.19	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	3'000	110	110	3'000 CHF	95.50%	2'865'000.00	0.12	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	0	2'800	650	2'150 CHF	93.60%	2'012'400.00	0.08	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	0	4'750	0	4'750 CHF	94.48%	4'487'800.00	0.18	a)
CH1148266195	0.6250 % SYN NVX 0 5/8 08/30/24	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	92.95%	1'766'050.00	0.07	a)
CH1148266237	0.3500 % BSTDBK 0.35 03/15/27 EMTN	200	0	0	200 CHF	82.95%	165'900.00	0.01	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	0	2'400	200	2'200 CHF	92.10%	2'026'200.00	0.08	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	0	1'800	110	1'690 CHF	95.55%	1'614'795.00	0.07	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	3'100	100	100	3'100 CHF	96.50%	2'991'500.00	0.12	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	2'000	3'200	170	5'030 CHF	96.75%	4'866'525.00	0.20	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	4'250	0	240	4'010 CHF	95.75%	3'839'575.00	0.16	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	5'525	0	0	5'525 CHF	95.50%	5'276'375.00	0.21	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	3'700	0	0	3'700 CHF	96.90%	3'585'300.00	0.14	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	0	3'200	200	3'000 CHF	92.80%	2'784'000.00	0.11	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	2'100	0	120	1'980 CHF	95.45%	1'889'910.00	0.08	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	93.45%	934'500.00	0.04	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	3'800	0	1'730	2'070 CHF	98.38%	2'036'466.00	0.08	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	4'200	0	280	3'920 CHF	96.85%	3'796'520.00	0.15	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	0	1'000	100	900 CHF	93.95%	845'550.00	0.03	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	2'020	0	100	1'920 CHF	98.31%	1'887'552.00	0.08	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	2'450	0	130	2'320 CHF	96.99%	2'250'168.00	0.09	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	2'550	0	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	96.90%	1'744'200.00	0.07	a)
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	98.55%	985'500.00	0.04	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	9'000	1'220	470	9'750 CHF	97.75%	9'530'625.00	0.39	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	1'700	0	120	1'580 CHF	96.79%	1'529'282.00	0.06	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'660	250	100	1'810 CHF	96.85%	1'752'985.00	0.07	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	2'400	100	100	2'400 CHF	96.95%	2'326'800.00	0.09	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'900	0	160	3'740 CHF	96.45%	3'607'230.00	0.15	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	3'200	0	200	3'000 CHF	99.00%	2'970'000.00	0.12	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	4'900	0	330	4'570 CHF	97.95%	4'476'315.00	0.18	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'100	0	100	2'000 CHF	98.45%	1'969'000.00	0.08	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	0	4'550	260	4'290 CHF	99.11%	4'251'819.00	0.17	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	2'500	0	110	2'390 CHF	99.25%	2'372'075.00	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.
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'900	0	120	1'780 CHF	96.90%	1'724'820.00	0.07	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	3'500	0	320	3'180 CHF	97.40%	3'097'320.00	0.13	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	3'200	0	500	2'700 CHF	97.15%	2'623'050.00	0.11	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	600	0	100	500 CHF	97.85%	489'250.00	0.02	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	2'800	0	200	2'600 CHF	99.50%	2'587'000.00	0.10	a)
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	2'000	0	100	1'900 CHF	98.30%	1'867'700.00	0.08	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'800	0	100	1'700 CHF	98.43%	1'673'310.00	0.07	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	3'150	0	0	3'150 CHF	98.60%	3'105'900.00	0.13	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	3'960	0	210	3'750 CHF	98.20%	3'682'500.00	0.15	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	2'800	0	100	2'700 CHF	99.50%	2'686'500.00	0.11	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	0	2'550	350	2'200 CHF	99.10%	2'180'200.00	0.09	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'730	100	600	2'230 CHF	98.20%	2'189'860.00	0.09	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	97.30%	2'919'000.00	0.12	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	4'900	0	100	4'800 CHF	98.90%	4'747'200.00	0.19	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	2'700	0	100	2'600 CHF	100.00%	2'600'000.00	0.11	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	98.25%	2'947'500.00	0.12	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	0	1'300	110	1'190 CHF	97.60%	1'161'440.00	0.05	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	2'600	0	100	2'500 CHF	99.59%	2'489'750.00	0.10	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	3'100	0	200	2'900 CHF	99.45%	2'884'050.00	0.12	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	2'800	0	200	2'600 CHF	99.65%	2'590'900.00	0.10	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	3'500	0	210	3'290 CHF	99.15%	3'262'035.00	0.13	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	2'500	0	100	2'400 CHF	99.20%	2'380'800.00	0.10	a)
CH1187520478	1.1580 % HYUCAP 1.158 06/14/24 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	2'335	0	100	2'235 CHF	100.05%	2'236'117.50	0.09	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	99.65%	1'594'400.00	0.06	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	0	2'000	0	2'000 CHF	99.10%	1'982'000.00	0.08	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	3'500	0	900	2'600 CHF	98.95%	2'572'700.00	0.10	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	2'950	0	0	2'950 CHF	99.09%	2'923'155.00	0.12	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	2'500	0	100	2'400 CHF	99.50%	2'388'000.00	0.10	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	2'300	0	100	2'200 CHF	98.80%	2'173'600.00	0.09	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	3'600	0	120	3'480 CHF	101.55%	3'533'940.00	0.14	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	1'425	0	100	1'325 CHF	99.50%	1'318'375.00	0.05	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	2'600	0	100	2'500 CHF	98.10%	2'452'500.00	0.10	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	3'100	0	100	3'000 CHF	98.85%	2'965'500.00	0.12	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	2'900	0	200	2'700 CHF	99.95%	2'698'650.00	0.11	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	2'600	0	100	2'500 CHF	99.45%	2'486'250.00	0.10	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	1'320	400	600	1'120 CHF	99.15%	1'110'480.00	0.04	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	0	1'200	0	1'200 CHF	101.55%	1'218'600.00	0.05	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	2'800	0	140	2'660 CHF	101.00%	2'686'600.00	0.11	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	0	2'000	0	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.08	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	2'500	150	2'350 CHF	100.12%	2'352'820.00	0.10	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	3'200	0	200	3'000 CHF	100.25%	3'007'500.00	0.12	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	1'900	600	220	2'280 CHF	99.60%	2'270'880.00	0.09	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	2'800	0	200	2'600 CHF	99.94%	2'598'440.00	0.11	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	2'400	0	100	2'300 CHF	100.65%	2'314'950.00	0.09	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	7'700	0	600	7'100 CHF	100.75%	7'153'250.00	0.29	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	3'000	800	560	3'240 CHF	99.45%	3'222'180.00	0.13	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	3'200	0	200	3'000 CHF	100.90%	3'027'000.00	0.12	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	1'620	0	100	1'520 CHF	100.60%	1'529'120.00	0.06	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	2'400	100	2'300 CHF	101.10%	2'325'300.00	0.09	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	2'000	0	100	1'900 CHF	98.95%	1'880'050.00	0.08	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	3'000	0	100	2'900 CHF	101.50%	2'943'500.00	0.12	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	2'700	0	140	2'560 CHF	98.95%	2'533'120.00	0.10	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	2'250	0	100	2'150 CHF	98.90%	2'126'350.00	0.09	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	0	4'010	400	3'610 CHF	99.80%	3'602'780.00	0.15	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'860	0	510	2'350 CHF	99.10%	2'328'850.00	0.09	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'900	0	0	1'900 CHF	99.10%	1'882'900.00	0.08	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	3'200	300	150	3'350 CHF	100.55%	3'368'425.00	0.14	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.
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	3'200	0	100	3'100 CHF	99.05%	3'070'550.00	0.12	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	3'200	0	390	2'810 CHF	100.20%	2'815'620.00	0.11	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	1'440	0	100	1'340 CHF	101.55%	1'360'770.00	0.05	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	2'400	0	100	2'300 CHF	101.30%	2'329'900.00	0.09	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	4'000	0	250	3'750 CHF	105.35%	3'950'625.00	0.16	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'300	250	210	2'340 CHF	104.00%	2'433'600.00	0.10	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	1'300	0	100	1'200 CHF	100.75%	1'209'000.00	0.05	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	1'500	3'200	155	4'545 CHF	100.60%	4'572'270.00	0.18	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	2'245	1'450	150	3'545 CHF	101.65%	3'603'492.50	0.15	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	3'000	0	200	2'800 CHF	101.60%	2'844'800.00	0.11	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	0	2'500	250	2'250 CHF	100.30%	2'256'750.00	0.09	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	2'600	0	100	2'500 CHF	101.90%	2'547'500.00	0.10	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	1'800	0	120	1'680 CHF	100.05%	1'680'840.00	0.07	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'800	0	100	1'700 CHF	100.85%	1'714'450.00	0.07	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	5'100	280	780	4'600 CHF	100.50%	4'623'000.00	0.19	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	2'400	0	0	2'400 CHF	103.05%	2'473'200.00	0.10	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	2'000	0	100	1'900 CHF	100.25%	1'904'750.00	0.08	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'200	0	200	2'000 CHF	103.95%	2'079'000.00	0.08	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'200	300	100	1'400 CHF	102.00%	1'428'000.00	0.06	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	2'500	0	1'250	1'250 CHF	100.90%	1'261'250.00	0.05	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	3'910	0	220	3'690 CHF	102.30%	3'774'870.00	0.15	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	2'500	0	100	2'400 CHF	102.30%	2'455'200.00	0.10	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	1'400	0	100	1'300 CHF	103.20%	1'341'600.00	0.05	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	2'045	0	800	1'245 CHF	101.45%	1'263'052.50	0.05	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'700	0	100	1'600 CHF	100.85%	1'613'600.00	0.07	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	2'300	0	100	2'200 CHF	102.95%	2'264'900.00	0.09	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	600	500	100	1'000 CHF	101.10%	1'011'000.00	0.04	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	3'100	100	3'000 CHF	100.27%	3'008'100.00	0.12	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	400	0	0	400 CHF	102.40%	409'600.00	0.02	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'100	750	240	3'610 CHF	101.90%	3'678'590.00	0.15	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	3'000	0	660	2'340 CHF	100.45%	2'350'530.00	0.09	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	2'250	0	340	1'910 CHF	102.90%	1'965'390.00	0.08	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	2'800	0	210	2'590 CHF	100.45%	2'601'655.00	0.11	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	4'250	290	3'960 CHF	103.35%	4'092'660.00	0.17	a)
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	1'900	0	100	1'800 CHF	100.50%	1'809'000.00	0.07	a)
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	3'600	800	200	4'200 CHF	102.55%	4'307'100.00	0.17	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	2'300	0	170	2'130 CHF	101.05%	2'152'365.00	0.09	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	3'900	0	750	3'150 CHF	101.25%	3'189'375.00	0.13	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	2'300	0	100	2'200 CHF	104.80%	2'305'600.00	0.09	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'600	0	310	2'290 CHF	100.00%	2'290'000.00	0.09	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	101.25%	1'822'500.00	0.07	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	1'300	400	900 CHF	104.10%	936'900.00	0.04	a)
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	1'440	0	1'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	1'700	0	100	1'600 CHF	102.00%	1'632'000.00	0.07	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	2'600	0	160	2'440 CHF	100.15%	2'443'660.00	0.10	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	2'200	500	100	2'600 CHF	102.60%	2'667'600.00	0.11	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	3'000	0	220	2'780 CHF	100.95%	2'806'410.00	0.11	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEL 2.1375 12/13/27 EMTN	2'400	0	120	2'280 CHF	101.30%	2'309'640.00	0.09	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	1'300	200	120	1'380 CHF	101.55%	1'401'390.00	0.06	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	2'800	0	200	2'600 CHF	102.85%	2'674'100.00	0.11	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROil 2.15 12/19/24	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	2'600	0	100	2'500 CHF	100.00%	2'500'000.00	0.10	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	0	1'750	120	1'630 CHF	100.56%	1'639'128.00	0.07	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	1'540	500	100	1'940 CHF	101.25%	1'964'250.00	0.08	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBSW 2.05 07/24/28	0	3'000	0	3'000 CHF	102.65%	3'079'500.00	0.12	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	1'600	300	100	1'800 CHF	100.95%	1'817'100.00	0.07	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'100	300	0	1'400 CHF	101.15%	1'416'100.00	0.06	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	3'300	0	220	3'080 CHF	100.40%	3'092'320.00	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.
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	2'400	0	200	2'200 CHF	102.00%	2'244'000.00	0.09	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNWX 2.04 01/26/26	2'160	200	100	2'260 CHF	100.80%	2'278'080.00	0.09	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'675	0	200	1'475 CHF	100.20%	1'477'950.00	0.06	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	3'340	140	3'200 CHF	104.60%	3'347'200.00	0.14	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	5'900	300	5'600 CHF	102.75%	5'754'000.00	0.23	a)
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	0	1'400	100	1'300 CHF	100.42%	1'305'460.00	0.05	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	0	2'700	450	2'250 CHF	102.20%	2'299'500.00	0.09	a)
CH1239464808	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26 JUN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	615	600	0	1'215 CHF	103.75%	1'260'562.50	0.05	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	2'400	0	100	2'300 CHF	100.00%	2'300'000.00	0.09	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNWX 2.2588 07/26/28	0	3'500	200	3'300 CHF	102.65%	3'387'450.00	0.14	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	3'600	800	150	4'250 CHF	101.10%	4'296'750.00	0.17	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	3'200	0	230	2'970 CHF	102.00%	3'029'400.00	0.12	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	900	750	100	1'550 CHF	100.05%	1'550'775.00	0.06	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	2'000	400	200	2'200 CHF	101.30%	2'228'600.00	0.09	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	1'900	0	100	1'800 CHF	100.90%	1'816'200.00	0.07	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	1'400	250	110	1'540 CHF	102.75%	1'582'350.00	0.06	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLILJ 2.35 03/01/27	1'225	0	100	1'125 CHF	102.40%	1'152'000.00	0.05	a)
CH1243651986	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	2'200	1'000	100	3'100 CHF	101.70%	3'152'700.00	0.13	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	1'900	0	120	1'780 CHF	100.35%	1'786'230.00	0.07	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	900	250	120	1'030 CHF	100.75%	1'037'725.00	0.04	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	3'200	0	200	3'000 CHF	103.15%	3'094'500.00	0.13	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	2'200	200	2'000 CHF	101.75%	2'035'000.00	0.08	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	1'900	100	1'800 CHF	101.40%	1'825'200.00	0.07	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	1'900	100	1'800 CHF	101.65%	1'829'700.00	0.07	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	1'950	100	1'850 CHF	100.75%	1'863'875.00	0.08	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	3'300	0	100	3'200 CHF	102.35%	3'275'200.00	0.13	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	0	1'900	430	1'470 CHF	101.25%	1'488'375.00	0.06	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	0	1'600	100	1'500 CHF	102.35%	1'535'250.00	0.06	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	102.40%	2'252'800.00	0.09	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	3'800	110	3'690 CHF	101.90%	3'760'110.00	0.15	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	1'500	130	1'370 CHF	101.10%	1'385'070.00	0.06	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	4'400	200	4'200 CHF	102.00%	4'284'000.00	0.17	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	4'400	270	4'130 CHF	102.05%	4'214'665.00	0.17	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	0	2'500	100	2'400 CHF	103.45%	2'482'800.00	0.10	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	2'700	120	2'580 CHF	103.50%	2'670'300.00	0.11	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	2'900	140	2'760 CHF	101.50%	2'801'400.00	0.11	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	3'300	220	3'080 CHF	102.60%	3'160'080.00	0.13	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	3'000	230	2'770 CHF	102.20%	2'830'940.00	0.11	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	3'700	100	3'600 CHF	103.70%	3'733'200.00	0.15	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	1'700	200	1'500 CHF	101.20%	1'518'000.00	0.06	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	2'400	200	2'200 CHF	102.05%	2'245'100.00	0.09	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	2'800	110	2'690 CHF	102.20%	2'749'180.00	0.11	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	3'200	500	2'700 CHF	102.65%	2'771'550.00	0.11	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	4'900	280	4'620 CHF	102.45%	4'733'190.00	0.19	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	4'500	620	3'880 CHF	101.30%	3'930'440.00	0.16	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	102.10%	2'246'200.00	0.09	a)
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	0	1'400	100	1'300 CHF	104.75%	1'361'750.00	0.06	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	2'510	110	2'400 CHF	105.45%	2'530'800.00	0.10	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	5'470	640	4'830 CHF	102.00%	4'926'600.00	0.20	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	900	100	800 CHF	100.89%	807'120.00	0.03	a)
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	0	3'300	150	3'150 CHF	100.96%	3'180'240.00	0.13	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	3'400	200	3'200 CHF	102.55%	3'281'600.00	0.13	a)
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	0	2'400	100	2'300 CHF	102.10%	2'348'300.00	0.09	a)
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	2'000	200	1'800 CHF	101.30%	1'823'400.00	0.07	a)
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	1'800	100	1'700 CHF	101.70%	1'728'900.00	0.07	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.
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	0	1'700	370	1'330 CHF	100.55%	1'337'315.00	0.05	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	0	1'300	0	1'300 CHF	100.80%	1'310'400.00	0.05	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	3'380	200	3'180 CHF	101.65%	3'232'470.00	0.13	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	0	2'345	160	2'185 CHF	100.95%	2'205'757.50	0.09	a)
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	800	100	700 CHF	100.90%	706'300.00	0.03	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	5'300	230	5'070 CHF	101.90%	5'166'330.00	0.21	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	2'610	460	2'150 CHF	100.95%	2'170'425.00	0.09	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	3'000	0	3'000 CHF	100.85%	3'025'500.00	0.12	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	2'700	120	2'580 CHF	101.35%	2'614'830.00	0.11	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	3'400	200	3'200 CHF	103.50%	3'312'000.00	0.13	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	2'500	100	2'400 CHF	102.15%	2'451'600.00	0.10	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	2'130	0	2'130 CHF	101.45%	2'160'885.00	0.09	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	0	1'300	100	1'200 CHF	102.00%	1'224'000.00	0.05	a)
CH1271007952	2.3750 % HYNOE 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	100.90%	1'311'700.00	0.05	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	2'800	400	2'400 CHF	102.50%	2'460'000.00	0.10	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.75%	1'526'250.00	0.06	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	2'600	100	2'500 CHF	102.00%	2'550'000.00	0.10	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	3'565	190	3'375 CHF	104.00%	3'510'000.00	0.14	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	1'325	450	875 CHF	100.80%	882'000.00	0.04	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	100.65%	1'912'350.00	0.08	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	1'600	200	1'400 CHF	101.55%	1'421'700.00	0.06	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	0	1'800	200	1'600 CHF	100.89%	1'614'240.00	0.07	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	1'000	100	900 CHF	101.00%	909'000.00	0.04	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	2'400	100	2'300 CHF	101.45%	2'333'350.00	0.09	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	0	2'800	400	2'400 CHF	103.00%	2'472'000.00	0.10	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	0	975	100	875 CHF	101.33%	886'637.50	0.04	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	0	3'100	130	2'970 CHF	101.30%	3'008'610.00	0.12	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	2'500	100	2'400 CHF	104.30%	2'503'200.00	0.10	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	1'600	100	1'500 CHF	101.24%	1'518'600.00	0.06	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	1'800	200	1'600 CHF	104.00%	1'664'000.00	0.07	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	0	2'000	100	1'900 CHF	102.15%	1'940'850.00	0.08	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'195	100	1'095 CHF	102.10%	1'117'995.00	0.05	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	1'900	100	1'800 CHF	103.40%	1'861'200.00	0.08	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	0	2'200	120	2'080 CHF	102.15%	2'124'720.00	0.09	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	3'400	230	3'170 CHF	102.00%	3'233'400.00	0.13	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	2'200	100	2'100 CHF	101.70%	2'135'700.00	0.09	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	4'950	490	4'460 CHF	101.55%	4'529'130.00	0.18	a)
CH1280994299	2.9700 % NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN	0	2'600	200	2'400 CHF	101.85%	2'444'400.00	0.10	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	1'300	140	1'160 CHF	101.10%	1'172'760.00	0.05	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	3'700	340	3'360 CHF	102.20%	3'433'920.00	0.14	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	1'800	110	1'690 CHF	101.70%	1'718'730.00	0.07	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	0	3'600	120	3'480 CHF	101.30%	3'525'240.00	0.14	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	3'340	100	3'240 CHF	102.00%	3'304'800.00	0.13	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	2'600	0	2'600 CHF	101.65%	2'642'900.00	0.11	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	2'000	0	2'000 CHF	101.40%	2'028'000.00	0.08	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	0	3'200	0	3'200 CHF	101.25%	3'240'000.00	0.13	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	3'560	170	3'390 CHF	102.40%	3'471'360.00	0.14	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	3'400	160	3'240 CHF	101.35%	3'283'740.00	0.13	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	1'700	200	1'500 CHF	101.80%	1'527'000.00	0.06	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	3'500	100	3'400 CHF	101.30%	3'444'200.00	0.14	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	100.09%	1'701'530.00	0.07	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIB 1.9 09/08/26	0	1'500	100	1'400 CHF	101.05%	1'414'700.00	0.06	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	102.00%	2'346'000.00	0.09	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	2'400	100	2'300 CHF	102.45%	2'356'350.00	0.10	a)
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	0	1'600	200	1'400 CHF	101.70%	1'423'800.00	0.06	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	2'500	130	2'370 CHF	101.55%	2'406'735.00	0.10	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	3'900	380	3'520 CHF	101.30%	3'565'760.00	0.14	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.
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	0	2'700	120	2'580 CHF	102.35%	2'640'630.00	0.11	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	101.85%	2'546'250.00	0.10	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	3'100	140	2'960 CHF	101.80%	3'013'280.00	0.12	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	2'400	120	2'280 CHF	102.50%	2'337'000.00	0.09	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	2'400	110	2'290 CHF	102.50%	2'347'250.00	0.09	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	2'500	240	2'260 CHF	102.25%	2'310'850.00	0.09	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	2'800	100	2'700 CHF	101.70%	2'745'900.00	0.11	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	3'400	0	3'400 CHF	102.65%	3'490'100.00	0.14	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	102.55%	1'128'050.00	0.05	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'500	100	1'400 CHF	101.10%	1'415'400.00	0.06	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	101.65%	1'118'150.00	0.05	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	4'110	100	4'010 CHF	104.25%	4'180'425.00	0.17	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	2'600	100	2'500 CHF	101.25%	2'531'250.00	0.10	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	3'900	450	3'450 CHF	100.70%	3'474'150.00	0.14	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	101.75%	1'322'750.00	0.05	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	3'800	100	3'700 CHF	102.15%	3'779'550.00	0.15	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	0	1'400	0	1'400 CHF	100.85%	1'411'900.00	0.06	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	0	3'700	250	3'450 CHF	101.35%	3'496'575.00	0.14	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	0	800	0	800 CHF	101.50%	812'000.00	0.03	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	2'000	100	1'900 CHF	101.40%	1'926'600.00	0.08	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	2'400	130	2'270 CHF	101.30%	2'299'510.00	0.09	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	100.70%	1'711'900.00	0.07	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	1'900	400	1'500 CHF	101.60%	1'524'000.00	0.06	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	1'500	480	1'020 CHF	100.55%	1'025'610.00	0.04	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	2'900	350	2'550 CHF	99.87%	2'546'685.00	0.10	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLILJ 2 1/4 12/05/25	0	800	120	680 CHF	101.05%	687'140.00	0.03	a)
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	100.10%	1'101'100.00	0.04	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	0	2'200	0	2'200 CHF	100.20%	2'204'400.00	0.09	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	1'500	0	1'500 CHF	101.40%	1'521'000.00	0.06	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	0	600	0	600 CHF	100.70%	604'176.00	0.02	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	0	2'200	0	2'200 CHF	100.64%	2'214'080.00	0.09	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	3'300	0	3'300 CHF	100.10%	3'303'300.00	0.13	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	2'500	0	2'500 CHF	100.10%	2'502'500.00	0.10	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	2'460	0	2'460 CHF	100.60%	2'474'760.00	0.10	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	1'600	0	1'600 CHF	100.42%	1'606'752.00	0.06	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	100.39%	2'108'274.00	0.09	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	2'505	0	2'505 CHF	100.64%	2'521'131.95	0.10	a)

CHF **2'446'249'130.95** **98.86**

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	10'500'888.51	0.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'446'249'130.95	98.86
Sonstige Vermögenswerte	17'591'750.33	0.71
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'474'341'769.79	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-148'425.59	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'474'193'344.20	

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);	2'446'249'130.95	98.86
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Devisenkurse

EUR 1 = CHF 0.93183793

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.136	0.00 - 0.05	-	-
FA CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.136	0.00 - 0.05	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.136	0.00 - 0.05	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.37	-	0.136	0.00 - 0.05	-	-

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 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
DT CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	-
FA CHF	0.160	0.500	0.060	0.100	-
GT CHF	0.130	0.350	0.080	0.050	-
NT CHF	-	-	-	-	-

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

SBI® AAA-BBB 1-5 TR

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 14.05.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 17.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	0.80000	0.28000	0.52000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 14.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 17.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	0.83083	0.29079	0.54004
GT CHF	Nein	CHF	0.86824	0.30388	0.56436
NT CHF	Nein	CHF	0.99392	0.34787	0.64605

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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, neun Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V (nachfolgend auch "der / die Umbrella-Fonds") zu vereinigen und den Fondsvertrag des übertragenden Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu den Vereinigungen und zu den in Zusammenhang mit den Vereinigungen erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgenden Vereinigungen durchzuführen:

Übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Stichtag der Vereinigungen (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	22. November 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.		

2 Gründe für die Vereinigungen

Mit den Vereinigungen soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anleger ist. Die Vereinigungen erlauben das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglichen ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

Die Voraussetzungen für Vereinigungen sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist bei den übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 25 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum die übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V vereinigt. Die Vereinigungen erfolgen durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen werden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anleger und Anlegerinnen der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V. Die Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigungen überführt werden.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR

Am 23. November 2023 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V bzw. übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II aufgrund der Schlusskurse vom 22. November 2023 durchgeführt. Am 23. November 2023 (Bewertungstag), erfolgen die Vereinigungen durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 22. November 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 8. August 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

Den übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und des übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

Im Hinblick auf die Vereinigungen muss der Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 25 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen der übertragenden Teilvermögen für die Vereinigungen mit dem übernehmenden Teilvermögen in Einklang mit den betreffenden Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend).
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend).
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend).
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend).
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigungen und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen lautet neu wie folgt:

"Anlagen in OTC-Derivate (OTC-Geschäften) sind nur zulässig, wenn (i) die Gegenpartei ein beaufsichtigter, auf dieses Geschäft spezialisierter Finanzintermediär ist, und (ii) die OTC-Derivate täglich handelbar sind oder eine Rückgabe an den Emittenten jederzeit möglich ist. Zudem sind sie zuverlässig und nachvollziehbar bewertbar. Derivate können gemäss § 12 eingesetzt werden.

Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds). Als "andere kollektive Kapitalanlagen" im Sinne dieses Fondsvertrages gelten:

- *inländische kollektive Kapitalanlagen der Art "Effektenfonds", "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"), wenn deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen.*
- *ausländische offene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und bei denen die Auszahlung von Rücknahme-*

oder Rückkaufsbefugnissen keinen Beschränkungen unterliegt. Es handelt sich um kollektive Kapitalanlagen, (i) deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen; (ii) für welche in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile bzw. Aktien und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds oder Fonds der Art „Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“ und (iii) welche im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

- ausländische geschlossene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 30% begrenzen. Solche geschlossene kollektive Kapitalanlagen unterliegen in ihrem Heimatstaat überwiegend keiner Aufsicht. Soweit solche kollektive Kapitalanlagen in ihrem Heimatstaat einer Aufsicht unterliegen, wird diese nicht notwendigerweise nach der Praxis der Schweizer Aufsichtsbehörde als "gleichwertig" eingestuft. Zudem wird die internationale Amtshilfe nicht zwingend gewährleistet. Die Anlagepolitik der geschlossenen kollektiven Kapitalanlagen muss derjenigen eines Effektenfonds oder eines übrigen Fonds für traditionelle Anlagen gleichwertig sein (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"). Ihre Anteile bzw. Aktien müssen an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.
- Beteiligungen an Immobilienfonds (einschliesslich Real Estate Investment Trusts, REITs), die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.

Die Rücknahmefrequenz oder Liquidität der Zielfonds hat grundsätzlich derjenigen des betreffenden Teilvermögens zu entsprechen. Die Verwendung von Zielfonds darf nicht zu einer Veränderung des Anlagecharakters eines Teilvermögens führen. Nach ihrer Rechtsform kann es sich bei den Zielfonds um vertragsrechtliche Anlagefonds, kollektive Kapitalanlagen in gesellschaftsrechtlicher Form, liechtensteinische Treuunternehmen, Business Trusts nach dem Recht US-amerikanischer Gliedstaaten, Investmentvereine oder um Unit Trusts handeln.

Die Fondsleitung kann Anteile bzw. Aktien von offenen kollektiven Kapitalanlagen sowohl aus Ausgabe wie auf dem Sekundärmarkt erwerben und Anteile bzw. Aktien sowohl zurückgeben wie auf dem Sekundärmarkt veräussern.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 20 Ziff. 6 Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist. "

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 4 bis 12 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird wie folgt angepasst:

"Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE EMU Government Bond Index nach. Dabei kann die Fondsleitung, statt in sämtliche Titel des Referenzindex zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).

Das Teilvermögen

- a) investiert in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte von privaten, gemischtwirtschaftlichen und öffentlich-rechtlichen Schuldnern, welche Bestandteil des Referenzindex sind;
- b) darf vorübergehend in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die nicht im Referenzindex enthalten sind, von denen jedoch aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass sie in den Referenzindex aufgenommen werden;
- c) darf in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die aufgrund des Kriteriums Mindestrestlaufzeit aus dem Referenzindex gestrichen wurden;

- d) investiert in Derivate auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex und die oben erwähnten Anlagen sowie Indices, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;
- e) weist eine Modified Duration auf, die um nicht mehr als 0.5 von der Modified Duration des Referenzindex abweicht.
- f) investiert in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen, die auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex lauten sowie auf Indices lauten, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;

Mit Ausnahme der Anlagen gemäss lit. c oben müssen Anlagen (einschliesslich Derivate auf diesen Anlagen), die aus dem Referenzindex gestrichen werden, unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist veräussert werden.

Die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss lit. f oben dürfen 30% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten."

2.2 Flüssige Mittel

In den Vorschriften über flüssige Mittel (vgl. § 9 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen) wird präzisiert, dass die Fondsleitung für jedes Teilvermögen zusätzlich angemessene flüssige Mittel in der weiteren Zeichnungs-/Rücknahmewährung der Anteilsklassen halten darf.

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Effektenleihe der zu vereinigenden Teilvermögen werden dahingehend angepasst, dass die Fondsleitung für Rechnung der Teilvermögen Effektenleihe-Geschäfte tätigen darf (vgl. § 10 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). In der Folge lauten die neuen Bestimmungen:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen sämtliche Arten von Effekten ausleihen, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen worden sind, dürfen hingegen nicht ausgeliehen werden.
2. Die Fondsleitung kann die Effekten im eigenen Namen und auf eigene Rechnung einem Borger ausleihen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, die Effekten entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") einem Borger zur Verfügung zu stellen.
3. Die Fondsleitung tätigt die Effektenleihe nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Borgern und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahrern, die eine einwandfreie Durchführung der Effektenleihe gewährleisten.
4. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerktag nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die ausgeliehenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom ausleihfähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% ausleihen. Sichert hingegen der Borger oder der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerktag wieder rechtlich über die ausgeliehenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte ausleihfähige Bestand einer Art ausgeliehen werden.
5. Die Fondsleitung vereinbart mit dem Borger oder Vermittler, dass dieser zwecks Sicherstellung des Rückerstattungsanspruches zugunsten der Fondsleitung Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA verpfändet oder zu Eigentum überträgt. Der Wert der Sicherheiten muss angemessen sein und jederzeit mindestens 100% des Verkehrswerts der ausgeliehenen Effekten betragen. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art.

52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.

6. Der Borger oder Vermittler haftet für die pünktliche und uneingeschränkte Vergütung der während der Effektenleihe anfallenden Erträge, die Geltendmachung anderer Vermögensrechte sowie die vertragskonforme Rückerstattung von Effekten gleicher Art, Menge und Güte.
7. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung der Effektenleihe und überwacht namentlich die Einhaltung der Anforderungen an die Sicherheiten. Sie besorgt auch während der Dauer der Leihgeschäfte die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den ausgeliehenen Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.
8. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens darf die Fondsleitung auf Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen (vgl. § 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). Die neuen Bestimmungen lauten wie folgt:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen. Pensionsgeschäfte können entweder als "Repo" oder als "Reverse Repo" getätigt werden.

Das Repo ist ein Rechtsgeschäft, durch das eine Partei (Pensionsgeber) das Eigentum an Effekten gegen Bezahlung vorübergehend auf eine andere Partei (Pensionsnehmer) überträgt, und bei dem der Pensionsnehmer sich verpflichtet, dem Pensionsgeber bei Fälligkeit Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten. Der Pensionsgeber trägt das Kursrisiko der Effekten während der Dauer des Pensionsgeschäftes.

Das Repo ist aus der Sicht der Gegenpartei (Pensionsnehmer) ein Reverse Repo. Mit einem Reverse Repo erwirbt die Fondsleitung zwecks Geldanlage Effekten und vereinbart gleichzeitig, Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten.

2. Die Fondsleitung kann Pensionsgeschäfte im eigenen Namen und auf eigene Rechnung mit einer Gegenpartei abschliessen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") Pensionsgeschäfte mit einer Gegenpartei zu tätigen.
3. Die Fondsleitung tätigt Pensionsgeschäfte nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Gegenparteien und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahren, die eine einwandfreie Durchführung des Pensionsgeschäftes gewährleisten.
4. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung des Pensionsgeschäftes. Sie sorgt dafür, dass die Wertveränderungen der im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten täglich in Geld oder Effekten ausgeglichen werden (mark to market) und besorgt auch während der Dauer des Pensionsgeschäftes die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.

5. Die Fondsleitung darf für Repos sämtliche Arten von Effekten verwenden, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen wurden, dürfen nicht für Repos verwendet werden.
6. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerkzeuge nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die in Pension gegebenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom repofähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% für Repos verwenden. Sichert hingegen die Gegenpartei bzw. der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerkzeug wieder rechtlich über die in Pension gegebenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte repofähige Bestand einer Art für Repos verwendet werden.
7. Repos gelten als Kreditaufnahme gemäss § 13, es sei denn, die erhaltenen Mittel werden für die Übernahme von Effekten gleicher Art, Güte, Bonität und Laufzeit in Verbindung mit dem Abschluss eines Reverse Repo verwendet.
8. Die Fondsleitung darf im Rahmen eines Reverse Repo nur Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA erwerben. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art. 52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.
9. Forderungen aus Reverse Repo gelten als flüssige Mittel gemäss § 9 und nicht als Kreditgewährung gemäss § 13.
10. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Sodann wird, in Angleichung an die Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens, in § 12 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen betreffend weitere Angaben zu bestimmten Themen im Prospekt die bestehende Aufzählung angepasst. Angaben zu der allfällig aus der Verwendung von Derivaten resultierenden erhöhten Volatilität sowie Angaben zum allfälligen Einsatz von Kreditderivaten sind nicht mehr im Prospekt enthalten.

2.4 Risikoverteilung und Risiken

Die Fondsleitung hat neu die Limite von 10% (bisher 20%) bei Anlagen von Vermögen eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten einschliesslich Derivate zu berücksichtigen. Diese Grenze von 10% ist auf 20% angehoben, wenn der Emittent (oder ein allfälliger Garant) ein Rating von mindestens A- (S&P oder ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) aufweist oder wenn die Fondsleitung den Emittenten bzw. Garanten bei Fehlen eines Agenturratings gestützt auf ein internes Rating der Depotbank als von gleicher Qualität einstuft. Der Gesamtwert der Effekten und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei welchen mehr als 5% (bisher 10%) des Vermögens eines Teilvermögens angelegt sind, darf 40% (bisher 60%) des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens nicht übersteigen (vgl. § 15 Ziff. 3, 4, 13 und 14 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Zudem wird in § 13 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen präzisiert, dass sofern das Rating A-1 oder gleichwertig erreicht, die Beschränkung für Anlagen in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank 30% statt 20% des Vermögens eines Teilvermögens beträgt.

Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss § 13 Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners dürfen insgesamt 30% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen (bisher 20%) (vgl. § 15 Ziff. 7 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Die Bestimmung, wonach die Fondsleitung keine Beteiligungsrechte erwerben darf, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben, wird neu in § 13 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen aufgeführt.

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens werden weitere Ergänzungen vorgenommen. Die in Ziff. 3 von § 13 erwähnte Grenze ist von 10% auf 20% angehoben, wenn es sich um Pfandbriefe schweizerischer Pfandbriefinstitute mit erstklassigem Rating (AAA Rating von Standard & Poor's bzw. ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) handelt. Pfandbriefe bleiben bei der Anwendung der Grenze von 40% nach Ziff. 3 ausser Betracht. Zudem wird neu festgehalten, dass wenn für die Verpflichtungen ein Emittent bzw. eine Gegenpartei wie ein Garant einsteht, kann bei der Beurteilung des Gesamtengagements bei besserem Rating auch auf den Garant abgestellt werden. Sollte das Rating einer Gegenpartei oder eines Garanten unter das geforderte Mindestrating sinken, so sind die noch offenen Positionen unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist glattzustellen (vgl. § 13 Ziff. 15, 17 und 18 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten

In § 23 Ziff. 1 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird die Bestimmung ersatzlos gestrichen, wonach in jedem Fall mindestens 70% des jährlichen Nettoertrags inklusive der vorgetragenen Erträge früherer Rechnungsjahre ausgeschüttet werden.

4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen

In § 20 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird neu ausgeführt, dass die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen höchstens 3% p.a. betragen darf. Im Jahresbericht ist der maximale Satz der Verwaltungskommission der Zielfonds, in die investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen für diese Teilvermögen anzugeben.

5 Rücknahmebedingungen

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens wird in § 17 Ziff. 1 die Definition des Bankwerktages präzisiert. Als Bankwerktag gilt jeder Tag, an welchem die Banken in der Stadt Zürich geöffnet sind. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen und stadtzürcherischen Feiertagen statt sowie an Tagen, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1) oder wenn ausserordentliche Verhältnisse im Sinne von § 17 Ziff. 5 vorliegen.

Darüber hinaus wird ergänzt, dass die Ausgabe- und Rücknahmepreise auf jeweils vier Stellen nach dem Komma gerundet werden; vorbehalten bleiben Sonderfälle.

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die Laufzeit des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen und des übernehmenden Teilvermögens sowie die Voraussetzungen der Auflösung bei den zu vereinigenden Teilvermögen stimmen grundsätzlich überein.

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 Teil II Ziff. 2 und 5 der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge 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 Teilvermögens bzw. des Teilvermögens in bar verlangen können bzw. den Antrag auf Sachauslage stellen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.
(nachfolgend "übertragende Teilvermögen")

und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
(nachfolgend "übernehmendes Teilvermögen")

hinsichtlich

Vereinigungen vom 22. November 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigungen

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben die übertragenden Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 22. November 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 18. September 2023 in den Publikationsorganen der von den Vereinigungen betroffenen Teilvermögen über die geplanten Vereinigungen und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen wurden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 22. November 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögen auch für die übertragenden Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnis

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger der übertragenden Teilvermögen erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigungen basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 22. November 2023:

Übertragende Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	CH0215803948	EUR 92.68
	ST EUR	CH0302432049	EUR 84'132.27
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	CH0215803989	EUR 96.07
	ST EUR	CH0302432064	EUR 85'512.87
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	CH0215804037	EUR 92.78
	ST EUR	CH0302432072	EUR 85'501.30
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	CH0215804086	EUR 96.31
	ST EUR	CH0302432098	EUR 87'100.07
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	CH0215804110	EUR 94.48
	ST EUR	CH0302432130	EUR 86'717.01
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	CH0215804128	EUR 99.91
	ST EUR	CH0302432148	EUR 87'805.08
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	CH0215804268	EUR 110.75
	ST EUR	CH0302432163	EUR 93'922.69
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	NT EUR	CH0215804300	EUR 92.82
	ST EUR	CH0302432171	EUR 84'390.42
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	NT EUR	CH0215804342	EUR 108.42
	ST EUR	CH0302432254	EUR 93'153.61

Übernehmendes Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	NT EUR	CH0117045150	EUR 113.84

2.2 Umtauschverhältnisse

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

Übertragende Teilvermögen		
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis ¹
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	1 zu 0.8141069428
	ST EUR	1 zu 739.0454261124
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	1 zu 0.8438950298
	ST EUR	1 zu 751.1730216961
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8149953411
	ST EUR	1 zu 751.0714046741
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	1 zu 0.8459861506
	ST EUR	1 zu 765.1154933048
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	1 zu 0.8299593985
	ST EUR	1 zu 761.7506315166
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8776731516
	ST EUR	1 zu 771.3085595374
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	1 zu 0.9728371650

Übertragende Teilvermögen	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	ST EUR	1 zu 825.0476743532
	NT EUR	1 zu 0.8153282314
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	ST EUR	1 zu 741.3130290303
	NT EUR	1 zu 0.9524302585
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	ST EUR	1 zu 818.2917647532

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 30. November 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung der Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund II») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund V») per 22. November 2023 geprüft.

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

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

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigungen gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 21. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich