

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 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
ASTT CHF	38329244	CHF
BVG 3 Index 45	38329242	CHF
DT CHF	38329248	CHF
FA CHF	21580464	CHF
GT CHF	38329251	CHF
NT CHF	21580466	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 Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 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	34
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	34
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	34
7	Pauschale Verwaltungskommission	35
8	Benchmark	36
9	TER	36
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	37
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	37
12	Fussnoten	37
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	38
14	Pflichtpublikationen	40

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		6'577'810'810.65	5'454'152'733.48	5'622'350'312.07	6'041'491'635.85
Klasse ASTT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		249'743'217.14	235'934'459.58	245'458'482.86	257'417'172.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'584'296.849	2'548'189.921	2'419'872.612	2'462'084.733
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		96.6388	92.5890	101.4345	104.5525
Thesaurierung je Anteil		0.77	0.60	0.62	0.84
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse BVG 3 Index 45					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		136'871'033.69	140'264'593.83	162'380'783.02	152'378'410.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'466'275.860	1'559'410.758	1'638'373.643	1'483'038.745
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		93.3460	89.9472	99.1110	102.7474
Thesaurierung je Anteil		0.23	0.06	0.03	0.25
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.71 %	0.72 %	0.71 %	0.70 %
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		78'086'383.21	25'225'891.31	14'058'886.63	30'872'740.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		820'087.145	275'887.351	140'025.389	297'469.417
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		95.2172	91.4355	100.4024	103.7846
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.1821	91.6365	96.1978	96.0276
Thesaurierung je Anteil		0.76	0.60	0.62	0.83
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		188'848'795.90	113'176'002.02	128'521'779.61	144'966'557.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'155'461.190	1'330'418.705	1'378'513.686	1'495'327.578
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		87.6141	85.0680	93.2321	96.9464
Ausschüttung je Anteil		0.65	1.10	-	0.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		274'923'545.77	250'470'774.31	257'619'258.85	890'562'688.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'883'798.100	2'736'497.050	2'563'702.261	8'575'208.423
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		95.3338	91.5297	100.4872	103.8532
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.3073	91.7309	96.2791	96.0910
Thesaurierung je Anteil		0.79	0.62	0.65	0.86
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %	0.11 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'649'337'834.94	4'689'081'012.43	4'814'311'121.10	4'565'294'065.72
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		59'589'783.613	51'553'331.640	48'244'762.899	44'299'057.813
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		94.8038	90.9559	99.7893	103.0562
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		101.7385	91.1559	95.6104	95.3537
Thesaurierung je Anteil		0.89	0.72	0.76	0.97
Total Expense Ratio (Synthetische 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 ASTT CHF	4.37 %	7.32 %	-11.98 %	-1.92 %
Klasse BVG 3 Index 45	3.78 %	6.70 %	-12.49 %	-2.47 %
Klasse DT CHF	4.37 %	7.32 %	-11.98 %	-1.92 %
Klasse FA CHF	4.33 %	7.28 %	-12.02 %	-1.96 %
Klasse GT CHF	4.41 %	7.35 %	-11.95 %	-1.89 %
Klasse NT CHF	4.52 %	7.47 %	-11.86 %	-1.78 %
Benchmark	4.37 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	0.07 %	0.07 %	0.14 %	0.04 %

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 ASTT CHF	-
Klasse BVG 3 Index 45	-0.59 %
Klasse DT CHF	-
Klasse FA CHF	-0.04 %
Klasse GT CHF	0.04 %
Klasse NT CHF	0.15 %

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	27'706'286.81	24'918'506.28
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	5'190'297'628.95	4'197'566'608.93
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'322'196'384.83	1'204'408'944.44
Sonstige Vermögenswerte	37'783'962.64	27'424'232.83
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'577'984'263.23	5'454'318'292.48
Andere Verbindlichkeiten	-173'452.58	-165'559.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'577'810'810.65	5'454'152'733.48

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse ASTT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'548'189.921	2'419'872.612
Ausgegebene Anteile		44'552.263	128'317.309
Zurückgenommene Anteile		-8'445.335	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'584'296.849	2'548'189.921
Klasse BVG 3 Index 45			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'559'410.758	1'638'373.643
Ausgegebene Anteile		22'216.861	89'335.694
Zurückgenommene Anteile		-115'351.759	-168'298.579
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'466'275.860	1'559'410.758
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		275'887.351	140'025.389
Ausgegebene Anteile		598'566.455	163'203.561
Zurückgenommene Anteile		-54'366.661	-27'341.599
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		820'087.145	275'887.351
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'330'418.705	1'378'513.686
Ausgegebene Anteile		1'204'981.361	457'503.171
Zurückgenommene Anteile		-379'938.876	-505'598.152
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'155'461.190	1'330'418.705
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'736'497.050	2'563'702.261
Ausgegebene Anteile		1'907'758.088	927'024.505
Zurückgenommene Anteile		-1'760'457.038	-754'229.716
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'883'798.100	2'736'497.050
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		51'553'331.640	48'244'762.899
Ausgegebene Anteile		9'890'748.686	5'417'859.478
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		2'678'624.191	1'712'797.253
Zurückgenommene Anteile		-3'630'170.891	-3'156'287.461
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-902'750.013	-665'800.529
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		59'589'783.613	51'553'331.640

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	26.04.2023	123'523'428.57	1'358'886.129
Klasse NT CHF	30.05.2023	5'538'999.87	60'594.788
Klasse NT CHF	11.08.2023	41'343'460.85	450'079.643
Klasse NT CHF	30.08.2023	8'526'326.19	92'324.618
Klasse NT CHF	30.08.2023	1'630'252.13	17'652.668
Klasse NT CHF	12.09.2023	20'041'548.44	217'862.336
Klasse NT CHF	23.11.2023	11'307'852.35	121'215.476
Klasse NT CHF	22.01.2024	22'287'977.30	235'913.773
Klasse NT CHF	25.01.2024	11'724'299.19	124'094.760

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	24.02.2023	71'807'763.03	797'543.244
Klasse NT CHF	06.12.2023	10'007'636.09	105'206.769

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		5'454'152'733.48	5'622'350'312.07
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'681'408.92	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-15'248'415.08	-13'927'770.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		863'871'140.30	337'431'930.99
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		276'716'760.87	-491'701'738.91
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'577'810'810.65	5'454'152'733.48

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		130'362.89	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-140'590.52
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		48'345'564.43	36'441'719.77
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		10'608'365.75	5'622'940.39
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'790'548.81	3'576'263.57
Total Ertrag		64'874'841.88	45'500'333.21
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-1'975'983.07	-1'902'904.43
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'980'921.92	-1'979'107.07
Total Aufwand		-4'956'904.99	-3'882'011.50
Nettoertrag / Verlust		59'917'936.89	41'618'321.71
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-46'949'469.78	-64'456'425.78
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		4'204'308.17	2'312'803.67
Realisierter Erfolg		17'172'775.28	-20'525'300.40
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		259'543'985.59	-471'176'438.51
Gesamterfolg		276'716'760.87	-491'701'738.91

Verwendung des Erfolges

Klasse ASTT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	2'011'434.98	1'547'547.46
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'011'434.98	1'547'547.46
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'011'434.98	1'547'547.46
Total	2'011'434.98	1'547'547.46
Klasse BVG 3 Index 45	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	342'866.41	98'606.50
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	342'866.41	98'606.50
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	342'866.41	98'606.50
Total	342'866.41	98'606.50
Klasse DT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	629'209.47	165'552.76
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	629'209.47	165'552.76
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	220'223.31	57'943.47
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	408'986.16	107'609.29
Total	629'209.47	165'552.76
Klasse FA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	1'459'349.99	668'381.58
Vortrag des Vorjahres	12'234.77	807'313.77
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'471'584.76	1'475'695.35
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'401'049.78	1'463'460.58
Vortrag auf neue Rechnung	70'534.98	12'234.77
Total	1'471'584.76	1'475'695.35
Klasse GT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	2'295'193.96	1'719'884.05
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'295'193.96	1'719'884.05
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	803'317.89	601'959.42
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'491'876.07	1'117'924.63
Total	2'295'193.96	1'719'884.05
Klasse NT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	53'179'882.08	37'418'349.36
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	53'179'882.08	37'418'349.36
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	18'612'958.73	13'096'422.28
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	34'566'923.35	24'321'927.08
Total	53'179'882.08	37'418'349.36

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							5'190'297'628.95	78.90	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							5'190'297'628.95	78.90	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	64'934	7'800	2'015	70'719 CHF	113.08%	79'969'045.20	1.22	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	30'820	4'000	0	34'820 CHF	169.39%	58'981'598.00	0.90	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	42'138	18'000	1'700	58'438 CHF	123.63%	72'246'899.40	1.10	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	4'840	1'000	0	5'840 CHF	109.35%	6'386'040.00	0.10	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	4'050	2'500	0	6'550 CHF	101.35%	6'638'425.00	0.10	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	11'250	3'100	0	14'350 CHF	109.70%	15'741'950.00	0.24	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	3'590	1'000	0	4'590 CHF	101.49%	4'658'391.00	0.07	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	8'725	500	0	9'225 CHF	101.60%	9'372'600.00	0.14	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	10'240	0	0	10'240 CHF	101.80%	10'424'320.00	0.16	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'180	0	0	2'180 CHF	101.90%	2'221'420.00	0.03	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	6'990	1'000	500	7'490 CHF	106.75%	7'995'575.00	0.12	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	6'040	0	0	6'040 CHF	113.60%	6'861'440.00	0.10	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	2'700	0	0	2'700 CHF	102.30%	2'762'100.00	0.04	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	45'742	11'900	0	57'642 CHF	118.79%	68'472'931.80	1.04	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	8'980	3'500	0	12'480 CHF	103.80%	12'954'240.00	0.20	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'040	500	0	2'540 CHF	103.05%	2'617'470.00	0.04	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	2'110	1'000	0	3'110 CHF	114.30%	3'554'730.00	0.05	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	4'310	0	0	4'310 CHF	121.90%	5'253'890.00	0.08	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	2'400	1'000	0	3'400 CHF	102.14%	3'472'760.00	0.05	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	980	0	0	980 CHF	121.25%	1'188'250.00	0.02	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	2'440	0	0	2'440 CHF	110.60%	2'698'640.00	0.04	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	4'300	0	0	4'300 CHF	114.10%	4'906'300.00	0.07	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'510	0	0	1'510 CHF	111.55%	1'684'405.00	0.03	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	5'650	0	0	5'650 CHF	111.70%	6'311'050.00	0.10	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	6'050	2'000	0	8'050 CHF	100.84%	8'117'620.00	0.12	a)
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'420	0	0	1'420 CHF	115.80%	1'644'360.00	0.02	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	8'640	0	8'640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	2'855	500	0	3'355 CHF	106.37%	3'568'713.50	0.05	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	1'740	0	1'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	470	0	0	470 CHF	124.25%	583'975.00	0.01	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	35'778	2'900	0	38'678 CHF	108.02%	41'779'975.60	0.64	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	3'120	0	0	3'120 CHF	108.20%	3'375'840.00	0.05	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	4'200	0	0	4'200 CHF	101.20%	4'250'400.00	0.06	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	2'550	0	0	2'550 CHF	101.25%	2'581'875.00	0.04	a)
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	1'690	1'000	0	2'690 CHF	100.92%	2'714'748.00	0.04	a)
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	2'300	500	0	2'800 CHF	109.25%	3'059'000.00	0.05	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	2'475	500	0	2'975 CHF	107.35%	3'193'662.50	0.05	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'745	0	0	1'745 CHF	100.70%	1'757'215.00	0.03	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	1'800	1'600	0	3'400 CHF	104.20%	3'542'800.00	0.05	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	7'855	0	0	7'855 CHF	106.32%	8'351'436.00	0.13	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	3'820	0	0	3'820 CHF	100.85%	3'852'470.00	0.06	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'270	0	0	1'270 CHF	103.00%	1'308'100.00	0.02	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	9'305	3'200	0	12'505 CHF	103.27%	12'913'913.50	0.20	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'370	0	1'370	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	900	0	0	900 CHF	101.20%	910'800.00	0.01	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	102.10%	1'735'700.00	0.03	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	850	0	0	850 CHF	104.65%	889'525.00	0.01	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	101.80%	1'547'360.00	0.02	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'665	0	0	6'665 CHF	101.03%	6'733'649.50	0.10	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	225	0	0	225 CHF	103.60%	233'100.00	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	930	0	0	930 CHF	107.35%	998'355.00	0.02	a)
CH0119542634	2.0000 % EIB 2 11/30/35	750	0	10	740 CHF	107.45%	795'130.00	0.01	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'740	0	0	2'740 CHF	104.55%	2'864'670.00	0.04	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	2'615	0	0	2'615 CHF	104.00%	2'719'600.00	0.04	a)
CH0119983077	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 11/26/35	1'000	1'000	0	2'000 CHF	102.95%	2'059'000.00	0.03	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'115	0	0	8'115 CHF	103.75%	8'419'312.50	0.13	a)
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	900	0	0	900 CHF	103.75%	933'750.00	0.01	a)
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'480	0	0	1'480 CHF	104.95%	1'553'260.00	0.02	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	4'490	0	4'490	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	3'910	2'000	0	5'910 CHF	103.52%	6'118'032.00	0.09	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	4'790	7'785	0	12'575 CHF	108.15%	13'599'862.50	0.21	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'720	0	0	1'720 CHF	102.10%	1'756'120.00	0.03	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	108.00%	3'402'000.00	0.05	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	1'580	650	0	2'230 CHF	112.45%	2'507'635.00	0.04	a)
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	2'310	0	0	2'310 CHF	115.00%	2'656'500.00	0.04	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'650	0	0	2'650 CHF	102.25%	2'709'625.00	0.04	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	10'470	2'000	0	12'470 CHF	102.47%	12'778'009.00	0.19	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	100	0	0	100 CHF	110.85%	110'850.00	0.00	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	935	0	0	935 CHF	116.70%	1'091'145.00	0.02	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	4'520	0	0	4'520 CHF	102.20%	4'619'440.00	0.07	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	36'802	7'179	0	43'981 CHF	110.36%	48'537'431.60	0.74	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	47'057	8'000	0	55'057 CHF	109.98%	60'551'688.60	0.92	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	38'199	4'000	42'199	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	47'624	4'650	1'200	51'074 CHF	104.64%	53'443'833.60	0.81	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	3'375	1'400	0	4'775 CHF	102.20%	4'880'050.00	0.07	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	1'330	0	0	1'330 CHF	107.30%	1'427'090.00	0.02	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	1'420	0	0	1'420 CHF	108.55%	1'541'410.00	0.02	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	3'560	2'000	0	5'560 CHF	104.03%	5'784'068.00	0.09	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	3'040	0	0	3'040 CHF	116.35%	3'537'040.00	0.05	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	1'070	0	0	1'070 CHF	107.25%	1'147'575.00	0.02	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	400	0	0	400 CHF	104.05%	416'200.00	0.01	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	3'200	0	0	3'200 CHF	101.24%	3'239'680.00	0.05	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	2'000	0	0	2'000 CHF	101.40%	2'028'000.00	0.03	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	3'410	4'000	0	7'410 CHF	101.08%	7'490'028.00	0.11	a)
CH0137992803	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41	0	1'600	0	1'600 CHF	106.20%	1'699'200.00	0.03	a)
CH0138276859	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 10/04/41	1'000	250	0	1'250 CHF	106.65%	1'333'125.00	0.02	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	2'140	0	2'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	3'360	0	3'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'120	0	0	1'120 CHF	100.40%	1'124'480.00	0.02	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	8'100	0	8'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	1'480	1'200	0	2'680 CHF	100.00%	2'680'000.00	0.04	a)
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	4'310	0	4'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	2'280	0	0	2'280 CHF	101.00%	2'302'800.00	0.04	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	1'530	0	0	1'530 CHF	108.60%	1'661'580.00	0.03	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	0	650	0	650 CHF	100.15%	650'975.00	0.01	a)
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	4'580	0	0	4'580 CHF	101.74%	4'659'692.00	0.07	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	3'300	0	0	3'300 CHF	100.25%	3'308'250.00	0.05	a)
CH0143808365	1.5000 % BVZNSW 1 1/2 04/12/32	0	1'200	0	1'200 CHF	101.60%	1'219'200.00	0.02	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	7'170	0	0	7'170 CHF	100.76%	7'224'492.00	0.11	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	3'040	0	3'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	6'050	0	6'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	4'550	0	0	4'550 CHF	100.30%	4'563'650.00	0.07	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	3'060	2'000	0	5'060 CHF	101.75%	5'148'550.00	0.08	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'790	0	0	1'790 CHF	100.30%	1'795'370.00	0.03	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	6'000	0	1'000	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.08	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	9'200	2'000	0	11'200 CHF	100.19%	11'221'280.00	0.17	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	1'500	1'700	0	3'200 CHF	102.00%	3'264'000.00	0.05	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'850	0	0	1'850 CHF	99.90%	1'848'150.00	0.03	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.
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	1'380	0	0	1'380 CHF	102.25%	1'411'050.00	0.02	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	1'355	0	0	1'355 CHF	100.65%	1'363'807.50	0.02	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	5'600	400	0	6'000 CHF	101.26%	6'075'600.00	0.09	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	6'410	5'400	0	11'810 CHF	100.63%	11'884'403.00	0.18	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	39'520	7'300	0	46'820 CHF	100.63%	47'114'966.00	0.72	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	920	600	0	1'520 CHF	101.05%	1'535'960.00	0.02	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	3'075	0	0	3'075 CHF	100.95%	3'104'212.50	0.05	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	8'320	700	0	9'020 CHF	100.83%	9'094'866.00	0.14	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIE 1.45 06/07/27	1'240	250	0	1'490 CHF	100.00%	1'490'000.00	0.02	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	1'000	0	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	0.02	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'030	600	0	1'630 CHF	100.25%	1'634'075.00	0.02	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'085	750	0	2'835 CHF	100.55%	2'850'592.50	0.04	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	2'080	0	2'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	2'070	0	0	2'070 CHF	99.95%	2'068'965.00	0.03	a)
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	6'470	0	6'470	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	4'300	0	4'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	2'900	0	0	2'900 CHF	99.30%	2'879'700.00	0.04	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	2'200	1'000	0	3'200 CHF	100.50%	3'216'000.00	0.05	a)
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	7'270	3'000	0	10'270 CHF	100.09%	10'279'243.00	0.16	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	4'825	0	0	4'825 CHF	100.22%	4'835'615.00	0.07	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	2'970	0	0	2'970 CHF	99.95%	2'968'515.00	0.05	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	11'200	500	0	11'700 CHF	100.15%	11'717'550.00	0.18	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	440	0	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	2'000	500	0	2'500 CHF	100.05%	2'501'250.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	2'020	0	0	2'020 CHF	99.00%	1'999'800.00	0.03	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'420	0	0	1'420 CHF	100.20%	1'422'840.00	0.02	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	2'270	1'000	0	3'270 CHF	99.60%	3'256'920.00	0.05	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000	0	0	3'000 CHF	100.20%	3'006'000.00	0.05	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	3'680	0	3'680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	3'950	0	0	3'950 CHF	99.80%	3'942'100.00	0.06	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	4'350	0	4'350 CHF	102.60%	4'463'100.00	0.07	a)
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	2'210	0	2'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'160	0	2'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	2'240	0	0	2'240 CHF	98.75%	2'212'000.00	0.03	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	1'860	0	0	1'860 CHF	100.25%	1'864'650.00	0.03	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	6'550	0	0	6'550 CHF	100.23%	6'565'065.00	0.10	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	1'250	0	0	1'250 CHF	100.00%	1'250'000.00	0.02	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	4'260	0	0	4'260 CHF	101.00%	4'302'600.00	0.07	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	2'700	0	0	2'700 CHF	101.45%	2'739'150.00	0.04	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	1'240	0	0	1'240 CHF	102.20%	1'267'280.00	0.02	a)
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	2'300	0	0	2'300 CHF	101.10%	2'325'300.00	0.04	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	3'320	500	0	3'820 CHF	99.74%	3'810'068.00	0.06	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	1'255	1'000	0	2'255 CHF	100.25%	2'260'637.50	0.03	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'320	1'000	0	2'320 CHF	104.80%	2'431'360.00	0.04	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	400	1'140	0	1'540 CHF	100.80%	1'552'320.00	0.02	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	2'050	0	0	2'050 CHF	103.80%	2'127'900.00	0.03	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	1'170	3'710	0	4'880 CHF	100.60%	4'909'280.00	0.07	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'550	0	0	1'550 CHF	100.95%	1'564'725.00	0.02	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	3'300	0	0	3'300 CHF	99.82%	3'294'060.00	0.05	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	12'125	0	0	12'125 CHF	101.55%	12'312'937.50	0.19	a)
CH0212114653	1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43	1'110	0	0	1'110 CHF	104.35%	1'158'285.00	0.02	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	1'870	0	0	1'870 CHF	103.95%	1'943'865.00	0.03	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'570	800	0	2'370 CHF	100.25%	2'375'925.00	0.04	a)
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	1'080	0	0	1'080 CHF	102.05%	1'102'140.00	0.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	2'580	0	0	2'580 CHF	101.45%	2'617'410.00	0.04	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	1'670	800	0	2'470 CHF	106.20%	2'623'140.00	0.04	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	4'000	500	0	4'500 CHF	100.77%	4'534'650.00	0.07	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'610	1'400	0	3'010 CHF	104.20%	3'136'420.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	840	700	0	1'540 CHF	102.50%	1'578'500.00	0.02	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	6'700	3'400	0	10'100 CHF	100.41%	10'141'410.00	0.15	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	930	2'100	0	3'030 CHF	102.70%	3'111'810.00	0.05	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	1'340	800	0	2'140 CHF	107.95%	2'310'130.00	0.04	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'040	1'800	0	2'840 CHF	101.15%	2'872'660.00	0.04	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	3'380	0	0	3'380 CHF	107.85%	3'645'330.00	0.06	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	4'550	3'000	0	7'550 CHF	100.79%	7'609'645.00	0.12	a)
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	2'740	0	2'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'000	0	0	1'000 CHF	107.45%	1'074'500.00	0.02	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	2'940	0	0	2'940 CHF	101.55%	2'985'570.00	0.05	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	3'710	0	0	3'710 CHF	105.65%	3'919'615.00	0.06	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	2'920	0	2'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	38'160	9'950	0	48'110 CHF	100.75%	48'470'825.00	0.74	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	39'280	2'700	0	41'980 CHF	144.00%	60'451'200.00	0.92	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	41'277	4'400	0	45'677 CHF	98.19%	44'850'246.30	0.68	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	21'230	5'600	0	26'830 CHF	90.50%	24'281'150.00	0.37	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	43'260	18'400	1'000	60'660 CHF	95.82%	58'124'412.00	0.88	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	5'680	0	0	5'680 CHF	107.10%	6'083'280.00	0.09	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	600	0	0	600 CHF	106.35%	638'100.00	0.01	a)
CH0224761517	1.8750 % SIKASW 1 7/8 11/14/23	1'705	0	1'705	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	1'960	0	1'960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224923513	1.7500 % KBSh 1 3/4 10/28/25	1'090	0	0	1'090 CHF	100.35%	1'093'815.00	0.02	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	2'790	0	2'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	970	0	970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227694574	1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	1'200	0	0	1'200 CHF	100.02%	1'200'240.00	0.02	a)
CH0228138274	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/38	0	700	0	700 CHF	108.60%	760'200.00	0.01	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	0	1'300	0	1'300 CHF	110.90%	1'441'700.00	0.02	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	250	0	0	250 CHF	110.40%	276'000.00	0.00	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	1'850	0	0	1'850 CHF	105.68%	1'955'080.00	0.03	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	1'600	1'500	0	3'100 CHF	110.90%	3'437'900.00	0.05	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	830	0	0	830 CHF	107.85%	895'155.00	0.01	a)
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	3'350	0	3'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	2'940	0	0	2'940 CHF	100.20%	2'945'880.00	0.04	a)
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	3'190	0	3'190	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	6'330	4'000	0	10'330 CHF	100.68%	10'400'244.00	0.16	a)
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	400	0	0	400 CHF	102.60%	410'400.00	0.01	a)
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	2'095	0	0	2'095 CHF	111.26%	2'330'897.00	0.04	a)
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	2'210	0	0	2'210 CHF	100.15%	2'213'315.00	0.03	a)
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	7'720	0	7'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	2'820	0	2'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	3'820	4'000	0	7'820 CHF	100.23%	7'837'986.00	0.12	a)
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	2'940	1'500	4'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	750	0	0	750 CHF	100.60%	754'500.00	0.01	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	6'900	0	0	6'900 CHF	100.77%	6'953'130.00	0.11	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'100	1'600	0	3'700 CHF	102.10%	3'777'700.00	0.06	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMNvx 1 1/2 07/14/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	2'990	0	2'990	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	5'210	0	5'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	2'480	0	0	2'480 CHF	99.35%	2'463'880.00	0.04	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	100.30%	1'003'000.00	0.02	a)
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	1'500	0	1'500	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.
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'845	0	0	1'845 CHF	100.20%	1'848'690.00	0.03	a)
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	1'570	0	1'570	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'170	750	0	2'920 CHF	99.45%	2'903'940.00	0.04	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	4'150	1'500	0	5'650 CHF	101.40%	5'729'100.00	0.09	a)
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'800	330	0	2'130 CHF	99.70%	2'123'610.00	0.03	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	99.65%	2'790'200.00	0.04	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	7'450	0	7'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'600	290	0	1'890 CHF	99.50%	1'880'550.00	0.03	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	1'320	0	0	1'320 CHF	99.45%	1'312'740.00	0.02	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	5'030	0	800	4'230 CHF	99.55%	4'210'965.00	0.06	a)
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	6'450	1'000	0	7'450 CHF	99.25%	7'394'125.00	0.11	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	4'750	6'300	0	11'050 CHF	99.30%	10'972'650.00	0.17	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	97.50%	1'803'750.00	0.03	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	7'080	0	7'080	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	0	800	800	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	3'450	0	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	7'260	0	7'260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	2'570	1'000	1'000	2'570 CHF	99.95%	2'568'715.00	0.04	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	4'060	1'000	0	5'060 CHF	99.42%	5'030'652.00	0.08	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	2'250	1'000	0	3'250 CHF	97.65%	3'173'625.00	0.05	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	760	0	0	760 CHF	99.17%	753'692.00	0.01	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	2'750	0	2'750 CHF	99.43%	2'734'325.00	0.04	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'720	0	0	1'720 CHF	99.31%	1'708'132.00	0.03	a)
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	3'040	0	505	2'535 CHF	99.15%	2'513'452.50	0.04	a)
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	2'395	2'500	0	4'895 CHF	99.85%	4'887'657.50	0.07	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	4'150	0	0	4'150 CHF	96.55%	4'006'825.00	0.06	a)
CH0262286252	0.6250 % WKBSNW 0 5/8 12/15/23	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	0	2'250	0	2'250 CHF	99.49%	2'238'525.00	0.03	a)
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	7'620	0	7'620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	9'810	5'600	0	15'410 CHF	98.55%	15'186'555.00	0.23	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	11'950	0	0	11'950 CHF	98.97%	11'826'915.00	0.18	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRI 0.55 02/03/25	6'580	0	1'400	5'180 CHF	98.87%	5'121'466.00	0.08	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	2'330	0	0	2'330 CHF	94.90%	2'211'170.00	0.03	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	1'400	0	0	1'400 CHF	98.45%	1'378'300.00	0.02	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	7'720	2'240	0	9'960 CHF	94.40%	9'402'240.00	0.14	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	3'030	0	0	3'030 CHF	97.80%	2'963'340.00	0.05	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	1'100	0	0	1'100 CHF	92.00%	1'012'000.00	0.02	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'350	0	0	1'350 CHF	98.52%	1'330'020.00	0.02	a)
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	1'990	0	0	1'990 CHF	92.00%	1'830'800.00	0.03	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	6'450	2'500	0	8'950 CHF	95.79%	8'573'205.00	0.13	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	2'380	0	0	2'380 CHF	96.90%	2'306'220.00	0.04	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	940	0	0	940 CHF	96.85%	910'390.00	0.01	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	1'820	0	0	1'820 CHF	95.50%	1'738'100.00	0.03	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	2'360	0	0	2'360 CHF	96.55%	2'278'580.00	0.03	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'910	1'100	0	3'010 CHF	93.75%	2'821'875.00	0.04	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'560	1'990	0	3'550 CHF	96.95%	3'441'725.00	0.05	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	1'130	0	0	1'130 CHF	95.95%	1'084'235.00	0.02	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	7'610	0	0	7'610 CHF	96.66%	7'355'826.00	0.11	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	7'000	1'000	0	8'000 CHF	93.45%	7'476'000.00	0.11	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	1'150	0	0	1'150 CHF	98.74%	1'135'510.00	0.02	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	910	0	0	910 CHF	97.10%	883'610.00	0.01	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'120	0	0	1'120 CHF	94.55%	1'058'960.00	0.02	a)
CH0273347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	0	2'400	0	2'400 CHF	99.25%	2'382'000.00	0.04	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	10'220	0	0	10'220 CHF	98.77%	10'094'294.00	0.15	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	7'280	2'000	0	9'280 CHF	96.28%	8'934'784.00	0.14	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	1'200	500	0	1'700 CHF	97.45%	1'656'650.00	0.03	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	6'900	0	1'000	5'900 CHF	97.20%	5'734'800.00	0.09	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.
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	0	1'550	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'250	500	0	2'750 CHF	98.59%	2'711'225.00	0.04	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	96.70%	1'353'800.00	0.02	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'720	0	0	2'720 CHF	95.95%	2'609'840.00	0.04	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'340	0	0	7'340 CHF	92.62%	6'798'308.00	0.10	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'530	0	0	1'530 CHF	98.40%	1'505'520.00	0.02	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	7'680	1'000	8'680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	5'520	3'600	0	9'120 CHF	94.85%	8'650'320.00	0.13	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'920	0	0	1'920 CHF	98.26%	1'886'592.00	0.03	a)
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	3'820	0	1'000	2'820 CHF	91.45%	2'578'890.00	0.04	a)
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	4'770	0	4'770	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	11'250	300	1'700	9'850 CHF	91.94%	9'056'090.00	0.14	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	2'140	1'000	0	3'140 CHF	98.36%	3'088'504.00	0.05	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	930	1'520	0	2'450 CHF	94.95%	2'326'275.00	0.04	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'485	0	0	1'485 CHF	98.62%	1'464'507.00	0.02	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	4'380	0	0	4'380 CHF	92.26%	4'040'988.00	0.06	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	4'930	0	0	4'930 CHF	91.18%	4'495'174.00	0.07	a)
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	4'330	0	4'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	1'590	0	0	1'590 CHF	96.00%	1'526'400.00	0.02	a)
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	4'050	500	0	4'550 CHF	98.53%	4'483'115.00	0.07	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	11'100	2'000	0	13'100 CHF	98.94%	12'961'140.00	0.20	a)
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	8'825	0	0	8'825 CHF	96.55%	8'520'537.50	0.13	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	5'280	1'285	0	6'565 CHF	93.80%	6'157'970.00	0.09	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	800	1'000	0	1'800 CHF	98.65%	1'775'700.00	0.03	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	590	0	0	590 CHF	96.00%	566'400.00	0.01	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	2'190	0	0	2'190 CHF	98.20%	2'150'580.00	0.03	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	6'880	1'500	0	8'380 CHF	97.75%	8'191'450.00	0.12	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	2'125	0	0	2'125 CHF	98.67%	2'096'737.50	0.03	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	7'750	2'000	0	9'750 CHF	98.64%	9'617'400.00	0.15	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.65%	986'500.00	0.01	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	5'700	2'000	0	7'700 CHF	98.08%	7'552'160.00	0.11	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	0	0	300 CHF	94.15%	282'450.00	0.00	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	10'500	0	0	10'500 CHF	94.65%	9'938'250.00	0.15	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBNSW 0.4 09/15/25	2'550	0	0	2'550 CHF	98.15%	2'502'825.00	0.04	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	7'120	0	0	7'120 CHF	98.32%	7'000'384.00	0.11	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	6'540	0	0	6'540 CHF	98.27%	6'426'858.00	0.10	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	6'150	500	0	6'650 CHF	94.37%	6'275'605.00	0.10	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	2'430	0	0	2'430 CHF	95.35%	2'317'005.00	0.04	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	2'620	0	0	2'620 CHF	95.30%	2'496'860.00	0.04	a)
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	0	7'265	0	7'265 CHF	98.20%	7'134'230.00	0.11	a)
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	1'110	0	1'110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	6'840	1'000	7'840	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	6'750	1'500	0	8'250 CHF	95.15%	7'849'875.00	0.12	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	97.75%	2'443'750.00	0.04	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	5'650	4'000	0	9'650 CHF	95.70%	9'235'050.00	0.14	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	3'230	0	0	3'230 CHF	98.80%	3'191'240.00	0.05	a)
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	2'745	500	0	3'245 CHF	95.20%	3'089'240.00	0.05	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	2'540	500	0	3'040 CHF	96.45%	2'932'080.00	0.04	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	6'220	1'500	0	7'720 CHF	92.80%	7'164'160.00	0.11	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.25%	1'945'000.00	0.03	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	4'000	1'500	0	5'500 CHF	97.45%	5'359'750.00	0.08	a)
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	5'160	0	5'160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	2'800	0	2'800	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.
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	800	0	0	800 CHF	95.90%	767'200.00	0.01	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	1'900	0	0	1'900 CHF	94.70%	1'799'300.00	0.03	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	7'080	0	0	7'080 CHF	97.49%	6'902'292.00	0.10	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	9'390	2'500	0	11'890 CHF	94.46%	11'231'294.00	0.17	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	0	500	0	500 CHF	99.10%	495'500.00	0.01	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	5'295	0	5'295 CHF	100.45%	5'318'827.50	0.08	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	8'740	0	1'200	7'540 CHF	95.83%	7'225'582.00	0.11	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	8'190	2'000	0	10'190 CHF	90.05%	9'176'095.00	0.14	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	9'390	1'250	0	10'640 CHF	97.38%	10'361'232.00	0.16	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	2'400	500	500	2'400 CHF	97.40%	2'337'600.00	0.04	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	6'280	1'500	2'000	5'780 CHF	96.05%	5'551'690.00	0.08	a)
CH0311427618	0.2000 % WKBNWS 0.2 08/19/24	500	1'000	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	2'550	250	0	2'800 CHF	95.30%	2'668'400.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	3'050	2'000	5'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	5'620	1'500	0	7'120 CHF	90.57%	6'448'584.00	0.10	a)
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	2'360	420	0	2'780 CHF	88.40%	2'457'520.00	0.04	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'720	0	0	1'720 CHF	97.50%	1'677'000.00	0.03	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	4'270	0	0	4'270 CHF	89.00%	3'800'300.00	0.06	a)
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	350	0	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	10'820	300	0	11'120 CHF	96.60%	10'741'920.00	0.16	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	1'350	3'500	0	4'850 CHF	96.95%	4'702'075.00	0.07	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26	650	0	0	650 CHF	97.00%	630'500.00	0.01	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	10'440	400	0	10'840 CHF	92.32%	10'007'488.00	0.15	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	10'260	0	0	10'260 CHF	94.71%	9'717'246.00	0.15	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	7'270	1'000	0	8'270 CHF	92.07%	7'614'189.00	0.12	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	9'210	0	0	9'210 CHF	89.16%	8'211'636.00	0.12	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	0	5'700	0	5'700 CHF	97.50%	5'557'500.00	0.08	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	0	350	0	350 CHF	96.30%	337'050.00	0.01	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'210	0	0	2'210 CHF	90.65%	2'003'365.00	0.03	a)
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31	0	1'100	0	1'100 CHF	91.45%	1'005'950.00	0.02	a)
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	700	0	0	700 CHF	92.20%	645'400.00	0.01	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	9'575	0	9'575	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	5'350	0	5'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	7'310	0	0	7'310 CHF	95.56%	6'985'436.00	0.11	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	5'640	400	0	6'040 CHF	83.25%	5'028'300.00	0.08	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'155	0	0	1'155 CHF	94.65%	1'093'207.50	0.02	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	7'410	0	0	7'410 CHF	84.17%	6'236'997.00	0.09	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	4'050	0	0	4'050 CHF	97.90%	3'964'950.00	0.06	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'030	500	0	2'530 CHF	80.00%	2'024'000.00	0.03	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'150	0	0	2'150 CHF	95.10%	2'044'650.00	0.03	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	5'790	2'300	0	8'090 CHF	83.70%	6'771'330.00	0.10	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	2'060	0	0	2'060 CHF	97.85%	2'015'710.00	0.03	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	350	0	0	350 CHF	90.85%	317'975.00	0.00	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	800	0	0	800 CHF	97.05%	776'400.00	0.01	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	2'990	0	0	2'990 CHF	93.85%	2'806'115.00	0.04	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	5'330	3'500	0	8'830 CHF	90.94%	8'030'002.00	0.12	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	4'050	0	0	4'050 CHF	81.60%	3'304'800.00	0.05	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	5'660	1'200	0	6'860 CHF	78.68%	5'397'448.00	0.08	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	870	0	0	870 CHF	96.60%	840'420.00	0.01	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	1'530	1'000	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	6'455	0	6'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	10'710	0	0	10'710 CHF	96.19%	10'301'949.00	0.16	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	7'830	5'800	0	13'630 CHF	90.75%	12'369'225.00	0.19	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	2'950	0	0	2'950 CHF	89.85%	2'650'575.00	0.04	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	8'650	0	0	8'650 CHF	96.58%	8'354'170.00	0.13	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	6'750	1'500	0	8'250 CHF	89.21%	7'359'825.00	0.11	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	7'790	0	0	7'790 CHF	80.67%	6'284'193.00	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.
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	0	5'020	0	5'020 CHF	96.50%	4'844'300.00	0.07	a)
CH0338330472	0.2500 % PSYHYPO 0 1/4 10/14/36 641	7'780	0	0	7'780 CHF	85.60%	6'659'680.00	0.10	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	5'260	0	1'500	3'760 CHF	93.75%	3'525'000.00	0.05	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	0	1'400	0	1'400 CHF	95.70%	1'339'800.00	0.02	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	2'750	600	0	3'350 CHF	80.90%	2'710'150.00	0.04	a)
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	0	7'030	7'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	0	3'450	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	4'235	0	0	4'235 CHF	76.65%	3'246'127.50	0.05	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	1'590	2'000	0	3'590 CHF	96.20%	3'453'580.00	0.05	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	2'270	0	0	2'270 CHF	80.85%	1'835'295.00	0.03	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	3'500	0	0	3'500 CHF	91.05%	3'186'750.00	0.05	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	5'000	500	0	5'500 CHF	90.95%	5'002'250.00	0.08	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	10'960	0	0	10'960 CHF	98.47%	10'792'312.00	0.16	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	11'120	0	0	11'120 CHF	98.76%	10'982'112.00	0.17	a)
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	5'500	1'000	0	6'500 CHF	95.75%	6'223'750.00	0.09	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	900	500	0	1'400 CHF	93.60%	1'310'400.00	0.02	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	250	0	0	250 CHF	95.35%	238'375.00	0.00	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	1'650	0	0	1'650 CHF	96.35%	1'589'775.00	0.02	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	24'070	15'400	600	38'870 CHF	90.57%	35'204'559.00	0.54	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	37'070	4'700	0	41'770 CHF	92.36%	38'578'772.00	0.59	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	35'340	4'000	0	39'340 CHF	97.43%	38'328'962.00	0.58	a)
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	700	0	0	700 CHF	98.42%	688'940.00	0.01	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	11'600	200	0	11'800 CHF	97.70%	11'528'600.00	0.18	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	3'260	0	0	3'260 CHF	96.60%	3'149'160.00	0.05	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	2'100	0	0	2'100 CHF	96.35%	2'023'350.00	0.03	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	3'650	250	0	3'900 CHF	94.60%	3'689'400.00	0.06	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	97.50%	1'852'500.00	0.03	a)
CH0347556901	0.1250 % PSYHYPO 0 1/8 05/06/25 643	9'360	0	0	9'360 CHF	98.28%	9'199'008.00	0.14	a)
CH0347556919	0.3750 % PSYHYPO 0 3/8 03/21/28 644	6'750	500	0	7'250 CHF	96.26%	6'978'850.00	0.11	a)
CH0347556927	0.6250 % PSYHYPO 0 5/8 01/23/37 645	7'715	1'000	0	8'715 CHF	89.46%	7'796'439.00	0.12	a)
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'800	0	0	2'800 CHF	92.90%	2'601'200.00	0.04	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	3'900	0	0	3'900 CHF	97.35%	3'796'650.00	0.06	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	11'850	1'500	0	13'350 CHF	96.71%	12'910'785.00	0.20	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	10'640	1'500	1'000	11'140 CHF	92.95%	10'354'630.00	0.16	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'150	0	0	2'150 CHF	95.80%	2'059'700.00	0.03	a)
CH0353428037	0.5000 % PSYHYPO 0 1/2 12/21/29 646	3'600	1'000	0	4'600 CHF	95.20%	4'379'200.00	0.07	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'240	0	0	1'240 CHF	94.30%	1'169'320.00	0.02	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	5'990	0	0	5'990 CHF	96.25%	5'765'375.00	0.09	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	1'330	0	0	1'330 CHF	98.78%	1'313'774.00	0.02	a)
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	1'050	0	0	1'050 CHF	97.10%	1'019'550.00	0.02	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	0	400	0	400 CHF	97.75%	391'000.00	0.01	a)
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	2'290	500	0	2'790 CHF	97.30%	2'714'670.00	0.04	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	0	2'250	0	2'250 CHF	97.15%	2'185'875.00	0.03	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	6'220	0	6'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	11'580	0	1'700	9'880 CHF	97.41%	9'624'108.00	0.15	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	14'510	0	0	14'510 CHF	95.33%	13'832'383.00	0.21	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	650	0	0	650 CHF	97.65%	634'725.00	0.01	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	800	1'000	0	1'800 CHF	89.40%	1'609'200.00	0.02	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	6'500	0	6'500 CHF	96.10%	6'246'500.00	0.09	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	98.05%	2'745'400.00	0.04	a)
CH0360172768	0.2500 % PSYHYPO 0 1/4 01/18/27 647	10'780	1'500	0	12'280 CHF	96.95%	11'905'460.00	0.18	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	6'650	0	6'650 CHF	96.60%	6'423'900.00	0.10	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	11'580	0	0	11'580 CHF	96.56%	11'181'648.00	0.17	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	4'450	0	0	4'450 CHF	94.70%	4'214'150.00	0.06	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	7'680	0	0	7'680 CHF	97.59%	7'494'912.00	0.11	a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'250	0	0	1'250 CHF	93.00%	1'162'500.00	0.02	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	4'330	1'500	0	5'830 CHF	97.96%	5'711'068.00	0.09	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'390	200	0	2'590 CHF	91.10%	2'359'490.00	0.04	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'670	150	0	1'820 CHF	90.20%	1'641'640.00	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.
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	2'150	0	0	2'150 CHF	92.10%	1'980'150.00	0.03	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	1'370	1'000	0	2'370 CHF	96.55%	2'288'235.00	0.03	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	1'340	0	0	1'340 CHF	88.90%	1'191'260.00	0.02	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	2'125	200	0	2'325 CHF	98.29%	2'285'242.50	0.03	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'900	0	0	1'900 CHF	95.40%	1'812'600.00	0.03	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	1'100	0	0	1'100 CHF	89.95%	989'450.00	0.02	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	6'740	0	6'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	5'150	0	0	5'150 CHF	91.12%	4'692'680.00	0.07	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	3'360	0	0	3'360 CHF	89.00%	2'990'400.00	0.05	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	97.95%	4'897'500.00	0.07	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	0	3'090	3'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'600	0	0	4'600 CHF	94.75%	4'358'500.00	0.07	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'800	0	0	1'800 CHF	95.90%	1'726'200.00	0.03	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	1'700	0	0	1'700 CHF	94.65%	1'609'050.00	0.02	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	1'200	0	0	1'200 CHF	97.70%	1'172'400.00	0.02	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	0	1'740	1'740	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	3'570	0	0	3'570 CHF	97.91%	3'495'387.00	0.05	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	9'200	0	1'000	8'200 CHF	97.19%	7'969'580.00	0.12	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	2'800	0	0	2'800 CHF	87.42%	2'447'760.00	0.04	a)
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	0	3'730	0	3'730 CHF	94.35%	3'519'255.00	0.05	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	3'525	1'500	5'025	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	10'650	1'800	0	12'450 CHF	95.94%	11'944'530.00	0.18	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	900	0	0	900 CHF	90.15%	811'350.00	0.01	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	8'190	0	0	8'190 CHF	96.06%	7'867'314.00	0.12	a)
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	0	2'800	0	2'800 CHF	97.70%	2'735'600.00	0.04	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	2'330	1'000	0	3'330 CHF	92.55%	3'081'915.00	0.05	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'730	700	0	4'430 CHF	95.80%	4'243'940.00	0.06	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	1'700	0	0	1'700 CHF	92.20%	1'567'400.00	0.02	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	11'830	1'000	700	12'130 CHF	96.63%	11'721'219.00	0.18	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	4'170	1'400	0	5'570 CHF	93.15%	5'188'455.00	0.08	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	3'000	0	0	3'000 CHF	97.65%	2'929'500.00	0.04	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	3'250	0	0	3'250 CHF	98.42%	3'198'650.00	0.05	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	9'700	2'000	0	11'700 CHF	96.20%	11'255'400.00	0.17	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'610	0	0	1'610 CHF	95.55%	1'538'355.00	0.02	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476784	0.5000 % KBSh 0 1/2 05/31/28	1'700	0	0	1'700 CHF	96.10%	1'633'700.00	0.02	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	0	5'950	0	5'950 CHF	98.70%	5'872'650.00	0.09	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	1'620	0	0	1'620 CHF	98.22%	1'591'164.00	0.02	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	2'660	2'800	0	5'460 CHF	93.66%	5'113'836.00	0.08	a)
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	0	2'075	2'075	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'150	0	0	2'150 CHF	96.35%	2'071'525.00	0.03	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'060	0	0	2'060 CHF	97.67%	2'012'002.00	0.03	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	3'020	250	0	3'270 CHF	94.25%	3'081'975.00	0.05	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	9'620	2'500	0	12'120 CHF	96.20%	11'659'440.00	0.18	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	0	3'350	0	3'350 CHF	96.30%	3'226'050.00	0.05	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'200	0	0	1'200 CHF	97.65%	1'171'800.00	0.02	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	3'200	3'000	0	6'200 CHF	97.10%	6'020'200.00	0.09	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	2'040	500	0	2'540 CHF	89.35%	2'269'490.00	0.03	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	1'890	0	0	1'890 CHF	89.90%	1'699'110.00	0.03	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	8'740	2'500	0	11'240 CHF	97.27%	10'933'148.00	0.17	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	4'600	2'000	0	6'600 CHF	95.19%	6'282'540.00	0.10	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	2'535	0	0	2'535 CHF	90.14%	2'285'049.00	0.03	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	900	0	0	900 CHF	90.05%	810'450.00	0.01	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'710	0	0	1'710 CHF	92.15%	1'575'765.00	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.
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'000	400	0	2'400 CHF	96.35%	2'312'400.00	0.04	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	5'740	0	0	5'740 CHF	96.55%	5'541'970.00	0.08	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	2'100	0	0	2'100 CHF	94.05%	1'975'050.00	0.03	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	560	0	0	560 CHF	97.50%	546'000.00	0.01	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'120	0	0	1'120 CHF	95.85%	1'073'520.00	0.02	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	0	3'100	0	3'100 CHF	97.60%	3'025'600.00	0.05	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	0	3'150	0	3'150 CHF	99.70%	3'140'550.00	0.05	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	3'480	0	0	3'480 CHF	95.50%	3'323'400.00	0.05	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	12'200	0	2'000	10'200 CHF	97.63%	9'958'260.00	0.15	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	1'230	0	0	1'230 CHF	95.40%	1'173'420.00	0.02	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	1'840	0	0	1'840 CHF	97.95%	1'802'280.00	0.03	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'550	0	0	1'550 CHF	96.50%	1'495'750.00	0.02	a)
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	500	0	0	500 CHF	98.55%	492'750.00	0.01	a)
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	3'900	0	0	3'900 CHF	98.34%	3'835'260.00	0.06	a)
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.15%	1'923'000.00	0.03	a)
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'270	1'500	0	2'770 CHF	97.05%	2'688'285.00	0.04	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	0	2'550	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	6'900	0	1'000	5'900 CHF	97.42%	5'747'780.00	0.09	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	6'780	1'000	0	7'780 CHF	94.31%	7'337'318.00	0.11	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	7'380	4'000	0	11'380 CHF	96.56%	10'988'528.00	0.17	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	410	0	0	410 CHF	97.15%	398'315.00	0.01	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	1'390	0	0	1'390 CHF	95.85%	1'332'315.00	0.02	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'000	0	0	2'000 CHF	96.30%	1'926'000.00	0.03	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	3'620	1'300	0	4'920 CHF	90.85%	4'469'820.00	0.07	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'520	0	0	1'520 CHF	83.35%	1'266'920.00	0.02	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	0	4'250	0	4'250 CHF	96.80%	4'114'000.00	0.06	a)
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	2'810	0	2'810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	2'000	500	0	2'500 CHF	97.35%	2'433'750.00	0.04	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	4'470	1'000	0	5'470 CHF	96.80%	5'294'960.00	0.08	a)
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	750	0	0	750 CHF	94.95%	712'125.00	0.01	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	3'150	0	0	3'150 CHF	97.80%	3'080'700.00	0.05	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'540	0	0	1'540 CHF	96.70%	1'489'180.00	0.02	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	1'900	0	0	1'900 CHF	95.65%	1'817'350.00	0.03	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.42%	984'200.00	0.01	a)
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	8'250	0	8'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'110	0	0	1'110 CHF	98.34%	1'091'574.00	0.02	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	1'940	500	0	2'440 CHF	97.30%	2'374'120.00	0.04	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	2'400	1'000	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	1'850	1'000	0	2'850 CHF	97.65%	2'783'025.00	0.04	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	1'720	0	0	1'720 CHF	98.34%	1'691'448.00	0.03	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	1'110	0	0	1'110 CHF	96.05%	1'066'155.00	0.02	a)
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	4'600	0	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	6'000	0	2'000	4'000 CHF	96.45%	3'858'000.00	0.06	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	2'830	1'500	500	3'830 CHF	98.14%	3'758'762.00	0.06	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	98.40%	2'164'800.00	0.03	a)
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	5'470	500	1'500	4'470 CHF	96.40%	4'309'080.00	0.07	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	2'500	0	0	2'500 CHF	95.85%	2'396'250.00	0.04	a)
CH0419040735	0.3000 % WKBSNW 0.3 02/01/27	1'800	0	0	1'800 CHF	96.50%	1'737'000.00	0.03	a)
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	2'190	1'800	0	3'990 CHF	94.50%	3'770'550.00	0.06	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	4'600	0	0	4'600 CHF	96.05%	4'418'300.00	0.07	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	1'700	0	0	1'700 CHF	95.15%	1'617'550.00	0.02	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	7'850	7'000	0	14'850 CHF	94.42%	14'021'370.00	0.21	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.
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	900	0	0	900 CHF	92.70%	834'300.00	0.01	a)
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'550	0	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	1'300	400	0	1'700 CHF	90.70%	1'541'900.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	11'150	200	0	11'350 CHF	94.86%	10'766'610.00	0.16	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	4'310	1'000	0	5'310 CHF	89.14%	4'733'334.00	0.07	a)
CH0419040974	0.8500 % KBLUZE 0.85 03/12/42	2'800	0	0	2'800 CHF	86.85%	2'431'800.00	0.04	a)
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'000	600	0	2'600 CHF	96.05%	2'497'300.00	0.04	a)
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'330	0	0	1'330 CHF	97.45%	1'296'085.00	0.02	a)
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	780	0	0	780 CHF	94.50%	737'100.00	0.01	a)
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'200	0	0	1'200 CHF	96.80%	1'161'600.00	0.02	a)
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'330	1'000	0	4'330 CHF	93.25%	4'037'725.00	0.06	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'440	0	0	1'440 CHF	91.40%	1'316'160.00	0.02	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	500	0	0	500 CHF	97.98%	489'900.00	0.01	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	7'400	0	0	7'400 CHF	93.85%	6'944'900.00	0.11	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	7'000	0	0	7'000 CHF	90.43%	6'330'100.00	0.10	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	1'260	0	0	1'260 CHF	89.00%	1'121'400.00	0.02	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'400	1'245	0	3'645 CHF	93.30%	3'400'785.00	0.05	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	1'060	0	0	1'060 CHF	84.00%	890'400.00	0.01	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	5'320	1'000	1'500	4'820 CHF	91.25%	4'398'250.00	0.07	a)
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	2'900	0	0	2'900 CHF	82.60%	2'395'400.00	0.04	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	2'050	0	0	2'050 CHF	84.95%	1'741'475.00	0.03	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'420	0	0	1'420 CHF	92.05%	1'307'110.00	0.02	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	3'000	500	0	3'500 CHF	81.10%	2'838'500.00	0.04	a)
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	2'500	0	800	1'700 CHF	75.25%	1'279'250.00	0.02	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	2'400	0	2'400 CHF	91.65%	2'199'600.00	0.03	a)
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	800	0	0	800 CHF	74.60%	596'800.00	0.01	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	4'700	0	0	4'700 CHF	77.50%	3'642'500.00	0.06	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	1'440	1'000	0	2'440 CHF	91.35%	2'228'940.00	0.03	a)
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	2'250	800	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	93.50%	1'776'500.00	0.03	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	1'800	1'000	0	2'800 CHF	97.20%	2'721'600.00	0.04	a)
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	3'330	0	3'330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	7'350	2'000	0	9'350 CHF	97.99%	9'162'065.00	0.14	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	7'500	3'390	0	10'890 CHF	96.06%	10'460'934.00	0.16	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'420	0	0	1'420 CHF	97.35%	1'382'370.00	0.02	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	2'200	1'000	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	8'860	1'500	0	10'360 CHF	96.01%	9'946'636.00	0.15	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'250	0	0	2'250 CHF	91.70%	2'063'250.00	0.03	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	500	0	0	500 CHF	99.29%	496'450.00	0.01	a)
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	0	9'450	0	9'450 CHF	98.20%	9'279'900.00	0.14	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	0	4'500	0	4'500 CHF	96.35%	4'335'750.00	0.07	a)
CH0434678352	1.1250 % BOBST 1 1/8 09/27/24	0	1'850	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'510	0	0	1'510 CHF	97.90%	1'478'290.00	0.02	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'300	0	0	6'300 CHF	96.87%	6'102'810.00	0.09	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	500	4'450	0	4'950 CHF	93.13%	4'609'935.00	0.07	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	3'550	0	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	720	0	0	720 CHF	96.55%	695'160.00	0.01	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	4'950	1'500	6'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'850	0	0	1'850 CHF	96.05%	1'776'925.00	0.03	a)
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	2'750	0	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	5'250	5'150	0	10'400 CHF	92.87%	9'658'480.00	0.15	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	17'570	16'100	0	33'670 CHF	91.70%	30'875'390.00	0.47	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.
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	31'760	8'300	500	39'560 CHF	87.01%	34'421'156.00	0.52	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	10'600	16'400	0	27'000 CHF	108.36%	29'257'200.00	0.44	a)
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	800	0	0	800 CHF	94.00%	752'000.00	0.01	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	0	200	0	200 CHF	98.30%	196'600.00	0.00	a)
CH0441186472	1.6300 % CPIPGR 1.63 10/25/23 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.70%	781'600.00	0.01	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	7'950	0	0	7'950 CHF	97.04%	7'714'680.00	0.12	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'840	1'000	0	9'840 CHF	97.70%	9'613'680.00	0.15	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	900	0	0	900 CHF	97.40%	876'600.00	0.01	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	3'530	0	0	3'530 CHF	96.55%	3'408'215.00	0.05	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0445625004	0.0000 % KTBS 0 11/28/23	3'580	0	3'580	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'800	0	0	1'800 CHF	97.45%	1'754'100.00	0.03	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	1'000	1'000	0	2'000 CHF	96.40%	1'928'000.00	0.03	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	93.95%	939'500.00	0.01	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	7'050	0	0	7'050 CHF	97.11%	6'846'255.00	0.10	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	1'120	0	0	1'120 CHF	92.70%	1'038'240.00	0.02	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'800	0	500	1'300 CHF	95.35%	1'239'550.00	0.02	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	3'700	0	0	3'700 CHF	95.65%	3'539'050.00	0.05	a)
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	2'800	0	0	2'800 CHF	95.80%	2'682'400.00	0.04	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	2'930	0	0	2'930 CHF	96.55%	2'828'915.00	0.04	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	0	2'900	0	2'900 CHF	98.05%	2'843'450.00	0.04	a)
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	300	0	0	300 CHF	97.35%	292'050.00	0.00	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'600	0	0	1'600 CHF	94.80%	1'516'800.00	0.02	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	7'000	0	0	7'000 CHF	89.42%	6'259'400.00	0.10	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	0	2'785	0	2'785 CHF	93.85%	2'613'722.50	0.04	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	94.75%	2'558'250.00	0.04	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	89.75%	2'513'000.00	0.04	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	94.05%	1'786'950.00	0.03	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	3'300	0	0	3'300 CHF	96.30%	3'177'900.00	0.05	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'900	0	0	1'900 CHF	84.85%	1'612'150.00	0.02	a)
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	0	5'000	1'000	4'000 CHF	91.00%	3'640'000.00	0.06	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	12'120	0	0	12'120 CHF	90.20%	10'932'240.00	0.17	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	500	0	0	500 CHF	94.90%	474'500.00	0.01	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	1'000	0	0	1'000 CHF	88.30%	883'000.00	0.01	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	81.25%	2'112'500.00	0.03	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	9'450	0	3'000	6'450 CHF	84.70%	5'463'150.00	0.08	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'750	0	0	1'750 CHF	86.25%	1'509'375.00	0.02	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	5'430	0	0	5'430 CHF	90.35%	4'906'005.00	0.07	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	7'425	0	0	7'425 CHF	90.50%	6'719'625.00	0.10	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	7'260	0	0	7'260 CHF	89.95%	6'530'370.00	0.10	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	90.75%	907'500.00	0.01	a)
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	610	0	0	610 CHF	95.20%	580'720.00	0.01	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	0	2'150	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	4'300	0	0	4'300 CHF	90.69%	3'899'670.00	0.06	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	5'000	0	1'300	3'700 CHF	97.31%	3'600'470.00	0.05	a)
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'720	0	0	1'720 CHF	93.60%	1'609'920.00	0.02	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	5'650	0	5'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	7'200	0	0	7'200 CHF	93.40%	6'724'800.00	0.10	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	7'360	0	0	7'360 CHF	95.55%	7'032'480.00	0.11	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	2'600	0	0	2'600 CHF	98.23%	2'553'980.00	0.04	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.
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	92.70%	1'205'100.00	0.02	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	98.61%	1'084'710.00	0.02	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'440	0	0	1'440 CHF	93.10%	1'340'640.00	0.02	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	830	0	0	830 CHF	98.60%	818'380.00	0.01	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	8'900	0	0	8'900 CHF	93.89%	8'356'210.00	0.13	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	96.85%	1'840'150.00	0.03	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	0	750	0	750 CHF	97.90%	734'250.00	0.01	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	2'000	0	0	2'000 CHF	93.65%	1'873'000.00	0.03	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	4'510	0	0	4'510 CHF	91.10%	4'108'610.00	0.06	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	1'520	0	0	1'520 CHF	91.80%	1'395'360.00	0.02	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	95.15%	2'378'750.00	0.04	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	7'290	0	0	7'290 CHF	91.77%	6'690'033.00	0.10	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	2'280	1'500	0	3'780 CHF	84.30%	3'186'540.00	0.05	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'030	0	0	1'030 CHF	92.00%	947'600.00	0.01	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	1'925	0	0	1'925 CHF	91.80%	1'767'150.00	0.03	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	94.15%	2'636'200.00	0.04	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	5'970	800	1'000	5'770 CHF	84.95%	4'901'615.00	0.07	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	6'050	1'500	0	7'550 CHF	95.72%	7'226'860.00	0.11	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	8'950	2'000	0	10'950 CHF	88.55%	9'696'225.00	0.15	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	4'960	950	0	5'910 CHF	82.94%	4'901'754.00	0.07	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	12'315	0	2'000	10'315 CHF	68.82%	7'098'783.00	0.11	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	1'370	0	0	1'370 CHF	91.95%	1'259'715.00	0.02	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	2'840	0	0	2'840 CHF	73.60%	2'090'240.00	0.03	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	440	0	0	440 CHF	95.70%	421'080.00	0.01	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'900	0	0	1'900 CHF	94.95%	1'804'050.00	0.03	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	1'540	0	0	1'540 CHF	85.55%	1'317'470.00	0.02	a)
CH0485445958	0.0000 % KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	2'690	0	0	2'690 CHF	97.75%	2'629'475.00	0.04	a)
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	1'650	0	0	1'650 CHF	90.40%	1'491'600.00	0.02	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	1'030	0	1'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	0	4'700	0	4'700 CHF	89.10%	4'187'700.00	0.06	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	4'350	0	1'500	2'850 CHF	97.70%	2'784'450.00	0.04	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	89.05%	1'870'050.00	0.03	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	2'850	500	0	3'350 CHF	62.15%	2'082'025.00	0.03	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	670	0	0	670 CHF	64.25%	430'475.00	0.01	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	0	3'850	0	3'850 CHF	95.90%	3'692'150.00	0.06	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	0	1'600	0	1'600 CHF	91.05%	1'456'800.00	0.02	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	3'650	0	3'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	1'320	0	0	1'320 CHF	70.60%	931'920.00	0.01	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	6'570	0	0	6'570 CHF	97.17%	6'384'069.00	0.10	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	91.20%	1'459'200.00	0.02	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	96.75%	1'451'250.00	0.02	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	2'060	1'000	0	3'060 CHF	94.80%	2'900'880.00	0.04	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	3'100	0	0	3'100 CHF	90.90%	2'817'900.00	0.04	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	3'330	0	0	3'330 CHF	83.55%	2'782'215.00	0.04	a)
CH0505011962	0.4500 % BSTDBK 0.45 06/13/23	2'785	0	2'785	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	4'440	300	0	4'740 CHF	91.70%	4'346'580.00	0.07	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	1'680	250	0	1'930 CHF	91.60%	1'767'880.00	0.03	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	5'100	0	0	5'100 CHF	93.75%	4'781'250.00	0.07	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	7'400	500	0	7'900 CHF	90.48%	7'147'920.00	0.11	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	3'570	1'220	0	4'790 CHF	78.59%	3'764'461.00	0.06	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	1'990	0	0	1'990 CHF	93.60%	1'862'640.00	0.03	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.
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	3'850	0	0	3'850 CHF	91.40%	3'518'900.00	0.05	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	94.70%	1'894'000.00	0.03	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	2'150	0	0	2'150 CHF	91.95%	1'976'925.00	0.03	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRI 0.14 06/12/30	2'600	0	0	2'600 CHF	91.55%	2'380'300.00	0.04	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.01	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	800	0	0	800 CHF	92.75%	742'000.00	0.01	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	7'290	0	1'300	5'990 CHF	88.25%	5'286'175.00	0.08	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'000	400	0	1'400 CHF	96.75%	1'354'500.00	0.02	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRI 0 02/05/31	2'160	850	0	3'010 CHF	89.70%	2'699'970.00	0.04	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	4'200	1'000	0	5'200 CHF	96.75%	5'031'000.00	0.08	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'660	800	0	2'460 CHF	86.90%	2'137'740.00	0.03	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	97.86%	1'565'760.00	0.02	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	6'400	0	0	6'400 CHF	90.47%	5'790'080.00	0.09	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'620	0	0	1'620 CHF	84.65%	1'371'330.00	0.02	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	2'400	0	0	2'400 CHF	92.55%	2'221'200.00	0.03	a)
CH0511762038	0.5225 % AFRFIN 0.5225 12/20/23 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	4'600	0	0	4'600 CHF	95.96%	4'414'160.00	0.07	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	6'580	0	2'800	3'780 CHF	90.70%	3'428'460.00	0.05	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	5'870	0	5'870	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	0	3'150	0	3'150 CHF	96.40%	3'036'600.00	0.05	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	4'120	0	0	4'120 CHF	97.47%	4'015'764.00	0.06	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	4'550	1'000	0	5'550 CHF	89.70%	4'978'350.00	0.08	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	600	1'000	0	1'600 CHF	87.60%	1'401'600.00	0.02	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	2'950	0	0	2'950 CHF	84.95%	2'506'025.00	0.04	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	0	5'700	0	5'700 CHF	91.75%	5'229'750.00	0.08	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBSW 0 02/14/29	2'100	0	0	2'100 CHF	92.95%	1'951'950.00	0.03	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	4'850	500	0	5'350 CHF	84.20%	4'504'700.00	0.07	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	1'850	0	0	1'850 CHF	93.65%	1'732'525.00	0.03	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	4'600	0	500	4'100 CHF	86.60%	3'550'600.00	0.05	a)
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	0	3'500	0	3'500 CHF	85.50%	2'992'500.00	0.05	a)
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	2'340	1'000	0	3'340 CHF	91.30%	3'049'420.00	0.05	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	1'100	0	0	1'100 CHF	89.45%	983'950.00	0.01	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	520	250	0	770 CHF	90.95%	700'315.00	0.01	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	0	2'700	0	2'700 CHF	85.70%	2'313'900.00	0.04	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRI 0.3126 02/02/32	3'000	0	0	3'000 CHF	90.45%	2'713'500.00	0.04	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	4'900	0	0	4'900 CHF	91.65%	4'490'850.00	0.07	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	2'100	250	0	2'350 CHF	93.00%	2'185'500.00	0.03	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	700	1'500	0	2'200 CHF	96.45%	2'121'900.00	0.03	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	3'500	0	1'200	2'300 CHF	100.45%	2'310'350.00	0.04	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	100.10%	2'502'500.00	0.04	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	2'700	0	0	2'700 CHF	101.65%	2'744'550.00	0.04	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'500	500	0	2'000 CHF	100.40%	2'008'000.00	0.03	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	2'500	0	0	2'500 CHF	99.60%	2'490'000.00	0.04	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	7'040	2'300	0	9'340 CHF	94.84%	8'858'056.00	0.13	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	4'950	1'000	1'000	4'950 CHF	72.60%	3'593'700.00	0.05	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	2'840	0	2'840	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	0	2'490	0	2'490 CHF	87.95%	2'189'955.00	0.03	a)
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	7'400	0	0	7'400 CHF	92.10%	6'815'400.00	0.10	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	1'700	0	0	1'700 CHF	96.15%	1'634'550.00	0.02	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	1'700	1'500	0	3'200 CHF	95.90%	3'068'800.00	0.05	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	3'000	1'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	9'420	0	9'420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	6'970	400	0	7'370 CHF	89.82%	6'619'734.00	0.10	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	3'480	0	0	3'480 CHF	78.98%	2'748'504.00	0.04	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	5'030	1'000	0	6'030 CHF	95.10%	5'734'530.00	0.09	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	3'970	600	0	4'570 CHF	76.60%	3'500'620.00	0.05	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	5'600	0	0	5'600 CHF	92.29%	5'168'240.00	0.08	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	3'600	0	0	3'600 CHF	81.50%	2'934'000.00	0.04	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	1'000	1'000	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.
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	6'700	350	0	7'050 CHF	86.55%	6'101'775.00	0.09	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	7'140	900	1'000	7'040 CHF	94.43%	6'647'872.00	0.10	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	6'635	200	0	6'835 CHF	85.60%	5'850'760.00	0.09	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	4'300	0	4'300 CHF	94.70%	4'072'100.00	0.06	a)
CH0536893362	0.1500 % WKBNSW 0.15 10/05/32	3'200	1'000	0	4'200 CHF	88.10%	3'700'200.00	0.06	a)
CH0536893370	0.6250 % SWICA 2020-1 A	1'210	0	1'210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	8'895	0	1'500	7'395 CHF	91.55%	6'770'122.50	0.10	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	2'900	0	1'000	1'900 CHF	74.85%	1'422'150.00	0.02	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	1'570	1'500	500	2'570 CHF	90.25%	2'319'425.00	0.04	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	2'140	300	0	2'440 CHF	83.55%	2'038'620.00	0.03	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	800	0	0	800 CHF	86.30%	690'400.00	0.01	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	6'600	0	600	6'000 CHF	95.95%	5'757'000.00	0.09	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	3'750	0	0	3'750 CHF	85.15%	3'193'125.00	0.05	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	1'720	0	1'720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.40%	964'000.00	0.01	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	11'600	1'500	3'000	10'100 CHF	95.01%	9'596'010.00	0.15	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'640	0	0	2'640 CHF	98.42%	2'598'288.00	0.04	a)
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	0	5'730	0	5'730 CHF	98.60%	5'649'780.00	0.09	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'390	0	0	1'390 CHF	88.35%	1'228'065.00	0.02	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	0	2'450	0	2'450 CHF	98.69%	2'417'905.00	0.04	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	4'150	0	4'150 CHF	96.65%	4'010'975.00	0.06	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'670	0	0	1'670 CHF	94.25%	1'573'975.00	0.02	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	2'750	0	0	2'750 CHF	91.50%	2'516'250.00	0.04	a)
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	2'430	0	0	2'430 CHF	93.55%	2'273'265.00	0.03	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	3'050	0	0	3'050 CHF	82.25%	2'508'625.00	0.04	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	300	0	300 CHF	96.35%	289'050.00	0.00	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	97.78%	1'955'600.00	0.03	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	1'640	1'000	0	2'640 CHF	98.02%	2'587'728.00	0.04	a)
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	3'410	1'570	0	4'980 CHF	93.10%	4'636'380.00	0.07	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	1'730	0	0	1'730 CHF	98.41%	1'702'493.00	0.03	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	5'200	0	0	5'200 CHF	94.30%	4'903'600.00	0.07	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	1'000	500	0	1'500 CHF	91.65%	1'374'750.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	1'000	0	0	1'000 CHF	78.25%	782'500.00	0.01	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	2'200	600	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	5'160	0	0	5'160 CHF	79.26%	4'089'816.00	0.06	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	2'010	0	0	2'010 CHF	75.55%	1'518'555.00	0.02	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	0	3'900	0	3'900 CHF	96.25%	3'753'750.00	0.06	a)
CH0553331825	0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30	0	1'700	0	1'700 CHF	91.95%	1'563'150.00	0.02	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	1'180	0	0	1'180 CHF	71.85%	847'830.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'210	0	0	5'210 CHF	92.25%	4'806'225.00	0.07	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	5'800	0	0	5'800 CHF	81.45%	4'724'100.00	0.07	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	5'300	1'000	0	6'300 CHF	98.00%	6'174'000.00	0.09	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	22'420	4'800	0	27'220 CHF	93.50%	25'450'700.00	0.39	a)
CH0557778716	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 FEB	0	5'600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778724	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 FEB	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778799	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 MAY	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778807	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 MAY	0	11'100	11'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	22'100	0	22'100 CHF	106.09%	23'445'890.00	0.36	a)
CH0557778823	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 JULY	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778831	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 JULY	0	4'700	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778849	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 SEP	0	3'900	3'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778856	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 SEP	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778864	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 OCT	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778880	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 OCT	0	4'100	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	4'000	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	3'300	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	1'780	0	0	1'780 CHF	63.45%	1'129'410.00	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.
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	4'250	0	0	4'250 CHF	79.45%	3'376'625.00	0.05	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	2'190	0	0	2'190 CHF	91.45%	2'002'755.00	0.03	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	5'550	0	0	5'550 CHF	92.10%	5'111'550.00	0.08	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	3'770	0	0	3'770 CHF	80.70%	3'042'390.00	0.05	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	3'800	0	0	3'800 CHF	89.65%	3'406'700.00	0.05	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	930	0	0	930 CHF	76.45%	710'985.00	0.01	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	3'400	0	0	3'400 CHF	97.10%	3'301'400.00	0.05	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	3'120	0	0	3'120 CHF	92.55%	2'887'560.00	0.04	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	2'780	0	0	2'780 CHF	87.35%	2'428'330.00	0.04	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'040	500	500	3'040 CHF	93.30%	2'836'320.00	0.04	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	97.20%	1'652'400.00	0.03	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	2'160	0	0	2'160 CHF	89.75%	1'938'600.00	0.03	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	0	3'680	0	3'680 CHF	95.65%	3'519'920.00	0.05	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'210	0	0	1'210 CHF	87.60%	1'059'960.00	0.02	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	13'600	0	0	13'600 CHF	92.03%	12'516'080.00	0.19	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	1'010	1'200	0	2'210 CHF	75.60%	1'670'760.00	0.03	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	3'000	0	0	3'000 CHF	94.80%	2'844'000.00	0.04	a)
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	0	4'650	0	4'650 CHF	90.15%	4'191'975.00	0.06	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	6'500	0	800	5'700 CHF	97.83%	5'576'310.00	0.08	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	4'250	0	0	4'250 CHF	88.05%	3'742'125.00	0.06	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	5'220	2'630	1'500	6'350 CHF	97.95%	6'219'825.00	0.09	a)
CH0575017014	0.6250 % SWMOB 2020-2 A	1'360	0	1'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	10'810	2'000	1'500	11'310 CHF	92.59%	10'471'929.00	0.16	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	9'410	0	0	9'410 CHF	88.98%	8'373'018.00	0.13	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	98.50%	1'182'000.00	0.02	a)
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	1'440	0	0	1'440 CHF	61.95%	892'080.00	0.01	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	980	0	0	980 CHF	90.50%	886'900.00	0.01	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	2'530	0	0	2'530 CHF	52.50%	1'328'250.00	0.02	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'630	2'020	1'300	2'350 CHF	95.00%	2'232'500.00	0.03	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	6'480	0	0	6'480 CHF	87.10%	5'644'080.00	0.09	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	9'500	0	0	9'500 CHF	93.59%	8'891'050.00	0.14	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	9'100	0	0	9'100 CHF	87.43%	7'956'130.00	0.12	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	9'640	1'375	0	11'015 CHF	83.50%	9'197'525.00	0.14	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	8'200	0	0	8'200 CHF	90.44%	7'416'080.00	0.11	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	2'140	0	0	2'140 CHF	86.15%	1'843'610.00	0.03	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	5'900	0	0	5'900 CHF	76.62%	4'520'580.00	0.07	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	94.45%	1'133'400.00	0.02	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	95.30%	1'620'100.00	0.02	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	2'700	0	800	1'900 CHF	85.30%	1'620'700.00	0.02	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	3'000	0	0	3'000 CHF	87.00%	2'610'000.00	0.04	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	0	5'500	0	5'500 CHF	89.40%	4'917'000.00	0.07	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	0	4'950	1'000	3'950 CHF	91.25%	3'604'375.00	0.05	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	0	5'100	0	5'100 CHF	94.40%	4'814'400.00	0.07	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'800	0	0	1'800 CHF	94.45%	1'700'100.00	0.03	a)
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	2'370	0	0	2'370 CHF	88.56%	2'098'872.00	0.03	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	2'000	250	0	2'250 CHF	80.82%	1'818'450.00	0.03	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'940	0	0	2'940 CHF	77.00%	2'263'800.00	0.03	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'840	0	0	1'840 CHF	79.40%	1'460'960.00	0.02	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	3'400	0	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	10'430	600	0	11'030 CHF	91.39%	10'080'317.00	0.15	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	2'200	0	0	2'200 CHF	89.20%	1'962'400.00	0.03	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	91.80%	1'836'000.00	0.03	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	2'600	0	0	2'600 CHF	97.25%	2'528'500.00	0.04	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	2'860	0	0	2'860 CHF	81.10%	2'319'460.00	0.04	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'280	1'400	0	3'680 CHF	90.70%	3'337'760.00	0.05	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	3'200	0	800	2'400 CHF	85.50%	2'052'000.00	0.03	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.
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	19'100	1'500	1'000	19'600 CHF	94.78%	18'576'880.00	0.28	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	5'400	0	1'500	3'900 CHF	89.50%	3'490'500.00	0.05	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	4'600	0	0	4'600 CHF	86.23%	3'966'580.00	0.06	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	5'010	1'300	0	6'310 CHF	88.50%	5'584'350.00	0.08	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	3'000	200	0	3'200 CHF	90.30%	2'889'600.00	0.04	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'650	0	0	1'650 CHF	92.40%	1'524'600.00	0.02	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	4'300	0	0	4'300 CHF	94.40%	4'059'200.00	0.06	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	3'000	300	0	3'300 CHF	91.95%	3'034'350.00	0.05	a)
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	1'800	1'000	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	4'710	500	0	5'210 CHF	90.70%	4'725'470.00	0.07	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	2'540	0	2'540 CHF	93.70%	2'379'980.00	0.04	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	8'170	2'000	0	10'170 CHF	91.04%	9'258'768.00	0.14	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	4'980	0	1'000	3'980 CHF	86.17%	3'429'566.00	0.05	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	6'710	0	1'000	5'710 CHF	81.94%	4'678'774.00	0.07	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'760	0	0	4'760 CHF	88.75%	4'224'500.00	0.06	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	3'800	0	0	3'800 CHF	90.30%	3'431'400.00	0.05	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	800	0	0	800 CHF	96.05%	768'400.00	0.01	a)
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	3'300	0	0	3'300 CHF	88.25%	2'912'250.00	0.04	a)
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	3'020	0	0	3'020 CHF	91.85%	2'773'870.00	0.04	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	5'900	1'500	2'500	4'900 CHF	90.65%	4'441'850.00	0.07	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	0	5'050	0	5'050 CHF	96.15%	4'855'575.00	0.07	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	0	4'950	0	4'950 CHF	93.15%	4'610'925.00	0.07	a)
CH1112940601	0.0500 % NIDKBK 0.05 05/27/31	2'110	0	0	2'110 CHF	89.15%	1'881'065.00	0.03	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	5'290	0	0	5'290 CHF	88.90%	4'702'810.00	0.07	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	4'320	0	0	4'320 CHF	90.05%	3'890'160.00	0.06	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	0	3'550	0	3'550 CHF	96.50%	3'425'750.00	0.05	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	4'000	0	500	3'500 CHF	90.35%	3'162'250.00	0.05	a)
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	0	5'150	0	5'150 CHF	91.55%	4'714'825.00	0.07	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	8'800	0	0	8'800 CHF	89.37%	7'864'560.00	0.12	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	2'550	0	0	2'550 CHF	81.95%	2'089'725.00	0.03	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483663	0.3500 % SWICC 2021-1 A	1'280	0	1'280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	89.50%	3'222'000.00	0.05	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	1'800	0	500	1'300 CHF	94.80%	1'232'400.00	0.02	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	89.80%	2'245'000.00	0.03	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	3'900	0	600	3'300 CHF	95.19%	3'141'270.00	0.05	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	2'890	0	0	2'890 CHF	80.28%	2'320'092.00	0.04	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	1'220	0	0	1'220 CHF	83.65%	1'020'530.00	0.02	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'000	0	0	2'000 CHF	77.95%	1'559'000.00	0.02	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33	2'900	0	0	2'900 CHF	86.75%	2'515'750.00	0.04	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	1'960	0	0	1'960 CHF	84.30%	1'652'280.00	0.03	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	0	4'125	0	4'125 CHF	90.25%	3'722'812.50	0.06	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	8'380	2'000	0	10'380 CHF	90.01%	9'343'038.00	0.14	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	3'400	0	0	3'400 CHF	82.70%	2'811'800.00	0.04	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	3'300	0	0	3'300 CHF	89.95%	2'968'350.00	0.05	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.65%	1'813'000.00	0.03	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	4'330	0	1'000	3'330 CHF	85.95%	2'862'135.00	0.04	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	2'350	0	0	2'350 CHF	93.70%	2'201'950.00	0.03	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	2'100	0	0	2'100 CHF	87.60%	1'839'600.00	0.03	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	4'170	1'200	0	5'370 CHF	90.80%	4'875'960.00	0.07	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	6'800	2'000	3'000	5'800 CHF	86.05%	4'990'900.00	0.08	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	3'300	1'000	500	3'800 CHF	88.20%	3'351'600.00	0.05	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	2'530	0	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	1'460	0	0	1'460 CHF	92.95%	1'357'070.00	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.
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	3'780	0	0	3'780 CHF	92.50%	3'496'500.00	0.05	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	92.80%	1'206'400.00	0.02	a)
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	0	500	0	500 CHF	89.60%	448'000.00	0.01	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'300	0	0	3'300 CHF	96.35%	3'179'550.00	0.05	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	1'920	0	1'920	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	2'100	2'500	0	4'600 CHF	73.60%	3'385'600.00	0.05	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	2'500	0	0	2'500 CHF	85.60%	2'140'000.00	0.03	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	3'000	0	0	3'000 CHF	97.88%	2'936'400.00	0.04	a)
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	2'350	0	0	2'350 CHF	92.40%	2'171'400.00	0.03	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	1'500	0	0	1'500 CHF	68.50%	1'027'500.00	0.02	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	94.85%	2'750'650.00	0.04	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	3'600	0	0	3'600 CHF	95.10%	3'423'600.00	0.05	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	3'350	0	0	3'350 CHF	90.96%	3'047'160.00	0.05	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'700	800	0	2'500 CHF	89.90%	2'247'500.00	0.03	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	95.50%	2'292'000.00	0.03	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	0	2'275	2'275	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	3'925	0	0	3'925 CHF	94.48%	3'708'340.00	0.06	a)
CH1148266245	0.3000 % WKBNWSW 0.3 02/07/30	300	0	0	300 CHF	92.90%	278'700.00	0.00	a)
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'700	500	0	2'200 CHF	92.50%	2'035'000.00	0.03	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	89.80%	2'155'200.00	0.03	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	92.10%	2'670'900.00	0.04	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	6'200	700	0	6'900 CHF	91.04%	6'281'760.00	0.10	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	3'900	750	0	4'650 CHF	92.40%	4'296'600.00	0.07	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'900	0	500	2'400 CHF	90.25%	2'166'000.00	0.03	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	2'100	0	0	2'100 CHF	91.12%	1'913'520.00	0.03	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	1'500	1'500	0	3'000 CHF	83.79%	2'513'700.00	0.04	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	0	2'600	0	2'600 CHF	96.50%	2'509'000.00	0.04	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	3'750	1'000	0	4'750 CHF	96.75%	4'595'625.00	0.07	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	3'900	0	0	3'900 CHF	94.39%	3'681'210.00	0.06	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	1'900	1'000	0	2'900 CHF	90.87%	2'635'230.00	0.04	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	2'100	0	0	2'100 CHF	89.85%	1'886'850.00	0.03	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	10'900	0	0	10'900 CHF	90.33%	9'845'970.00	0.15	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	2'200	0	0	2'200 CHF	94.15%	2'071'300.00	0.03	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	2'500	1'500	0	4'000 CHF	86.52%	3'460'800.00	0.05	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'900	250	0	4'150 CHF	95.50%	3'963'250.00	0.06	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	0	400	0	400 CHF	96.90%	387'600.00	0.01	a)
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	300	0	0	300 CHF	93.30%	279'900.00	0.00	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160112814	0.4650 % DHBKQD 0.465 01/24/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	1'300	0	0	1'300 CHF	93.95%	1'221'350.00	0.02	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	0	2'000	0	2'000 CHF	96.99%	1'939'800.00	0.03	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	1'800	0	0	1'800 CHF	92.50%	1'665'000.00	0.03	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	1'300	0	0	1'300 CHF	93.70%	1'218'100.00	0.02	a)
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	2'100	0	0	2'100 CHF	95.25%	2'000'250.00	0.03	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	14'400	0	14'400 CHF	97.75%	14'076'000.00	0.21	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	0	13'100	0	13'100 CHF	96.05%	12'582'550.00	0.19	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	0	6'300	0	6'300 CHF	94.05%	5'925'150.00	0.09	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	0	1'600	0	1'600 CHF	96.79%	1'548'640.00	0.02	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	0	1'500	0	1'500 CHF	91.90%	1'378'500.00	0.02	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'380	0	0	1'380 CHF	96.85%	1'336'530.00	0.02	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 CHF	96.95%	1'745'100.00	0.03	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	1'550	0	0	1'550 CHF	76.90%	1'191'950.00	0.02	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'800	0	0	3'800 CHF	96.45%	3'665'100.00	0.06	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.
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	0	2'000	0	2'000 CHF	95.30%	1'906'000.00	0.03 a)	
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	3'900	0	0	3'900 CHF	96.12%	3'748'680.00	0.06 a)	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	2'800	550	0	3'350 CHF	95.05%	3'184'175.00	0.05 a)	
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	1'800	0	0	1'800 CHF	93.48%	1'682'640.00	0.03 a)	
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'500	0	0	2'500 CHF	98.45%	2'461'250.00	0.04 a)	
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	1'800	0	0	1'800 CHF	97.40%	1'753'200.00	0.03 a)	
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	1'060	600	0	1'660 CHF	99.25%	1'647'550.00	0.03 a)	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	3'800	1'000	0	4'800 CHF	99.11%	4'757'280.00	0.07 a)	
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	3'100	4'300	0	7'400 CHF	99.51%	7'363'740.00	0.11 a)	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	4'300	1'800	0	6'100 CHF	99.32%	6'058'520.00	0.09 a)	
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	96.90%	1'065'900.00	0.02 a)	
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	97.40%	2'142'800.00	0.03 a)	
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	97.15%	2'720'200.00	0.04 a)	
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	3'700	1'800	0	5'500 CHF	97.66%	5'371'300.00	0.08 a)	
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	1'700	0	0	1'700 CHF	92.57%	1'573'690.00	0.02 a)	
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	97.00%	1'649'000.00	0.03 a)	
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	97.85%	1'076'350.00	0.02 a)	
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	3'000	0	0	3'000 CHF	96.60%	2'898'000.00	0.04 a)	
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'800	0	0	1'800 CHF	98.43%	1'771'740.00	0.03 a)	
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	2'200	0	1'250	950 CHF	96.30%	914'850.00	0.01 a)	
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	3'100	0	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	97.20%	2'235'600.00	0.03 a)	
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	3'100	500	0	3'600 CHF	98.20%	3'535'200.00	0.05 a)	
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	97.50%	2'340'000.00	0.04 a)	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	0	3'900	0	3'900 CHF	98.85%	3'855'150.00	0.06 a)	
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	99.10%	2'378'400.00	0.04 a)	
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.95%	2'374'800.00	0.04 a)	
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	5'750	5'900	0	11'650 CHF	99.53%	11'595'245.00	0.18 a)	
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	6'800	2'700	2'000	7'500 CHF	101.55%	7'616'250.00	0.12 a)	
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	0	2'450	0	2'450 CHF	98.20%	2'405'900.00	0.04 a)	
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	6'300	0	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	1'400	750	0	2'150 CHF	97.60%	2'098'400.00	0.03 a)	
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	3'500	0	3'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	2'800	500	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	2'400	0	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	2'500	0	0	2'500 CHF	99.10%	2'477'500.00	0.04 a)	
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	2'600	800	0	3'400 CHF	99.05%	3'367'700.00	0.05 a)	
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	3'650	0	3'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	2'040	0	2'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217768	1.7000 % KTSPL 1.7 06/24/32	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	6'300	2'900	0	9'200 CHF	100.82%	9'275'440.00	0.14 a)	
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	11'400	0	0	11'400 CHF	101.96%	11'623'440.00	0.18 a)	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	3'300	4'000	0	7'300 CHF	106.21%	7'753'330.00	0.12 a)	
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	3'200	0	0	3'200 CHF	112.75%	3'608'000.00	0.05 a)	
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	3'300	1'000	0	4'300 CHF	100.50%	4'321'500.00	0.07 a)	
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	2'700	8'140	0	10'840 CHF	101.51%	11'003'684.00	0.17 a)	
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	2'900	3'250	0	6'150 CHF	103.28%	6'351'720.00	0.10 a)	
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	3'100	0	0	3'100 CHF	100.25%	3'107'750.00	0.05 a)	
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	6'600	500	0	7'100 CHF	100.15%	7'110'650.00	0.11 a)	
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	2'200	0	0	2'200 CHF	98.10%	2'158'200.00	0.03 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.
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	3'400	0	0	3'400 CHF	103.60%	3'522'400.00	0.05	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	2'000	750	0	2'750 CHF	98.85%	2'718'375.00	0.04	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	99.45%	1'690'650.00	0.03	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	2'000	0	0	2'000 CHF	101.75%	2'035'000.00	0.03	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	3'500	0	0	3'500 CHF	101.00%	3'535'000.00	0.05	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'680	0	0	1'680 CHF	100.25%	1'684'200.00	0.03	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	3'300	0	3'300 CHF	100.12%	3'303'960.00	0.05	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	3'250	0	3'250 CHF	104.95%	3'410'875.00	0.05	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	99.94%	3'098'140.00	0.05	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	4'700	0	0	4'700 CHF	105.45%	4'956'150.00	0.08	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	5'700	3'800	0	9'500 CHF	110.47%	10'494'650.00	0.16	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	2'900	3'850	0	6'750 CHF	118.93%	8'027'775.00	0.12	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	1'900	400	0	2'300 CHF	100.65%	2'314'950.00	0.04	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	2'000	900	0	2'900 CHF	99.45%	2'884'050.00	0.04	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	1'080	0	0	1'080 CHF	107.00%	1'155'600.00	0.02	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	100.90%	2'320'700.00	0.04	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	850	0	0	850 CHF	112.45%	955'825.00	0.01	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	2'950	0	2'950 CHF	101.10%	2'982'450.00	0.05	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'800	0	0	1'800 CHF	98.95%	1'781'100.00	0.03	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	2'100	500	0	2'600 CHF	101.50%	2'639'000.00	0.04	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	1'100	0	0	1'100 CHF	105.25%	1'157'750.00	0.02	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	4'400	0	0	4'400 CHF	98.95%	4'353'800.00	0.07	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	4'300	800	0	5'100 CHF	104.80%	5'344'800.00	0.08	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	1'500	0	0	1'500 CHF	99.00%	1'485'000.00	0.02	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	1'800	500	0	2'300 CHF	100.20%	2'304'600.00	0.04	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	2'400	0	0	2'400 CHF	98.90%	2'373'600.00	0.04	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'610	0	0	2'610 CHF	99.10%	2'586'510.00	0.04	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	99.00%	2'079'000.00	0.03	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	3'700	0	0	3'700 CHF	99.47%	3'680'390.00	0.06	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	2'000	3'800	0	5'800 CHF	99.73%	5'784'340.00	0.09	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	1'500	250	0	1'750 CHF	98.45%	1'722'875.00	0.03	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	2'500	0	0	2'500 CHF	99.10%	2'477'500.00	0.04	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	2'400	250	0	2'650 CHF	99.05%	2'624'825.00	0.04	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	3'300	0	0	3'300 CHF	102.05%	3'367'650.00	0.05	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	4'400	0	0	4'400 CHF	100.83%	4'436'520.00	0.07	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	3'400	3'700	0	7'100 CHF	104.20%	7'398'200.00	0.11	a)
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	1'600	2'100	0	3'700 CHF	104.51%	3'866'870.00	0.06	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	4'200	0	0	4'200 CHF	107.32%	4'507'440.00	0.07	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	2'600	0	0	2'600 CHF	100.75%	2'619'500.00	0.04	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	600	3'000	0	3'600 CHF	100.60%	3'621'600.00	0.06	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	5'100	0	0	5'100 CHF	104.70%	5'339'700.00	0.08	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	2'400	4'130	0	6'530 CHF	110.50%	7'215'650.00	0.11	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	0	6'680	0	6'680 CHF	101.65%	6'790'220.00	0.10	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'615	0	0	1'615 CHF	113.80%	1'837'870.00	0.03	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	3'300	0	0	3'300 CHF	101.60%	3'352'800.00	0.05	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	0	5'550	0	5'550 CHF	102.70%	5'699'850.00	0.09	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	3'800	1'500	0	5'300 CHF	101.60%	5'384'800.00	0.08	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	2'800	2'000	0	4'800 CHF	98.75%	4'740'000.00	0.07	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	3'100	300	0	3'400 CHF	100.30%	3'410'200.00	0.05	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	1'100	250	200	1'150 CHF	100.05%	1'150'575.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	700	500	0	1'200 CHF	102.05%	1'224'600.00	0.02	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	1'100	0	0	1'100 CHF	100.95%	1'110'450.00	0.02	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	100.85%	1'311'050.00	0.02	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'300	0	0	1'300 CHF	103.10%	1'340'300.00	0.02	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	0	10'000	0	10'000 CHF	100.50%	10'050'000.00	0.15	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	0	7'500	0	7'500 CHF	105.00%	7'875'000.00	0.12	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	101.55%	2'538'750.00	0.04	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	0	4'300	0	4'300 CHF	106.60%	4'583'800.00	0.07	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	2'800	0	0	2'800 CHF	100.25%	2'807'000.00	0.04	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.
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'800	500	1'000	2'300 CHF	101.90%	2'343'700.00	0.04	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	4'000	6'100	0	10'100 CHF	104.83%	10'587'830.00	0.16	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	102.00%	1'122'000.00	0.02	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	900	1'200	0	2'100 CHF	111.05%	2'332'050.00	0.04	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'700	0	0	1'700 CHF	100.85%	1'714'450.00	0.03	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	1'800	0	0	1'800 CHF	102.95%	1'853'100.00	0.03	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	101.10%	909'900.00	0.01	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	2'400	500	400	2'500 CHF	115.50%	2'887'500.00	0.04	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	1'500	0	1'500 CHF	102.30%	1'534'500.00	0.02	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	0	1'500	0	1'500 CHF	104.05%	1'560'750.00	0.02	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	1'300	0	1'300 CHF	100.27%	1'303'510.00	0.02	a)
CH1218301948	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 06/25/24 729	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	2'600	5'600	0	8'200 CHF	105.36%	8'639'520.00	0.13	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	7'700	1'000	0	8'700 CHF	109.20%	9'500'400.00	0.14	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	104.20%	1'146'200.00	0.02	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	3'100	0	0	3'100 CHF	101.90%	3'158'900.00	0.05	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	960	0	0	960 CHF	117.15%	1'124'640.00	0.02	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	1'890	0	0	1'890 CHF	106.00%	2'003'400.00	0.03	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	2'880	0	2'880	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	2'700	1'000	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	3'800	1'800	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	102.50%	3'895'000.00	0.06	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	1'100	0	0	1'100 CHF	104.80%	1'152'800.00	0.02	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'800	0	0	2'800 CHF	100.00%	2'800'000.00	0.04	a)
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	1'100	300	0	1'400 CHF	101.75%	1'424'500.00	0.02	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	100.15%	1'502'250.00	0.02	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	2'600	1'500	0	4'100 CHF	104.65%	4'290'650.00	0.07	a)
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	0	1'900	300	1'600 CHF	102.90%	1'646'400.00	0.03	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	1'200	0	0	1'200 CHF	103.45%	1'241'400.00	0.02	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	0	3'200	0	3'200 CHF	102.80%	3'289'600.00	0.05	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	0	3'800	0	3'800 CHF	105.45%	4'007'100.00	0.06	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	102.30%	1'432'200.00	0.02	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	800	500	0	1'300 CHF	101.30%	1'316'900.00	0.02	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	2'200	0	0	2'200 CHF	100.00%	2'200'000.00	0.03	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	810	250	0	1'060 CHF	100.56%	1'065'936.00	0.02	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	5'300	0	0	5'300 CHF	102.05%	5'408'650.00	0.08	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	6'700	0	0	6'700 CHF	102.95%	6'897'650.00	0.10	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	1'100	0	0	1'100 CHF	102.60%	1'128'600.00	0.02	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBSW 2.05 07/24/28	2'000	250	0	2'250 CHF	102.65%	2'309'625.00	0.04	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	2'400	0	0	2'400 CHF	102.40%	2'457'600.00	0.04	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	1'600	0	0	1'600 CHF	101.25%	1'620'000.00	0.02	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	0	3'600	0	3'600 CHF	103.00%	3'708'000.00	0.06	a)
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	1'100	0	0	1'100 CHF	101.85%	1'120'350.00	0.02	a)
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	102.70%	1'540'500.00	0.02	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	0	2'300	0	2'300 CHF	101.15%	2'326'450.00	0.04	a)
CH1236363409	1.7575 % NWISE 1.7575 01/23/26	3'800	500	0	4'300 CHF	100.40%	4'317'200.00	0.07	a)
CH1236363417	2.0125 % NWISE 2.0125 01/23/30	2'200	1'750	1'000	2'950 CHF	103.05%	3'039'975.00	0.05	a)
CH1239464535	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 FEB	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464543	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 FEB	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	3'200	0	0	3'200 CHF	105.05%	3'361'600.00	0.05	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	1'600	0	0	1'600 CHF	110.00%	1'760'000.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'750	0	0	1'750 CHF	100.20%	1'753'500.00	0.03	a)
CH1239464618	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464626	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR	0	4'200	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	0	6'530	0	6'530 CHF	108.36%	7'075'908.00	0.11	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.
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	2'600	0	2'600 CHF	110.50%	2'873'000.00	0.04	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	3'100	0	3'100 CHF	117.25%	3'634'750.00	0.06	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	3'950	0	3'950 CHF	104.60%	4'131'700.00	0.06	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	4'800	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	0	1'800	0	1'800 CHF	100.42%	1'807'560.00	0.03	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	4'400	0	4'400 CHF	103.59%	4'557'960.00	0.07	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	5'900	0	5'900 CHF	104.74%	6'179'660.00	0.09	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	4'310	0	4'310 CHF	106.15%	4'575'065.00	0.07	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	0	1'800	0	1'800 CHF	102.20%	1'839'600.00	0.03	a)
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	0	2'715	0	2'715 CHF	102.85%	2'792'377.50	0.04	a)
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	1'600	500	0	2'100 CHF	102.15%	2'145'150.00	0.03	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	2'300	2'400	0	4'700 CHF	102.07%	4'797'290.00	0.07	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	7'000	0	0	7'000 CHF	103.40%	7'238'000.00	0.11	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	665	0	665	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'800	0	0	1'800 CHF	101.75%	1'831'500.00	0.03	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	3'200	500	0	3'700 CHF	100.00%	3'700'000.00	0.06	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	3'700	500	0	4'200 CHF	101.10%	4'246'200.00	0.06	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	100.05%	1'700'850.00	0.03	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'900	0	0	2'900 CHF	101.55%	2'944'950.00	0.04	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	0	5'800	0	5'800 CHF	104.85%	6'081'300.00	0.09	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	0	5'100	0	5'100 CHF	103.15%	5'260'650.00	0.08	a)
CH1243651960	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 FEB	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 FEB	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651986	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	2'100	0	0	2'100 CHF	100.35%	2'107'350.00	0.03	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	1'200	0	0	1'200 CHF	100.75%	1'209'000.00	0.02	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	2'500	1'250	0	3'750 CHF	101.90%	3'821'250.00	0.06	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	101.75%	2'136'750.00	0.03	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	2'100	0	2'100 CHF	101.65%	2'134'650.00	0.03	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	102.35%	1'125'850.00	0.02	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	102.45%	1'434'300.00	0.02	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	0	3'800	0	3'800 CHF	103.80%	3'944'400.00	0.06	a)
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	3'100	0	3'100 CHF	101.90%	3'158'900.00	0.05	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	0	6'200	0	6'200 CHF	104.74%	6'493'880.00	0.10	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	6'500	0	6'500 CHF	106.44%	6'918'600.00	0.11	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	0	4'500	0	4'500 CHF	102.05%	4'592'250.00	0.07	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	2'055	0	2'055 CHF	102.65%	2'109'457.50	0.03	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	2'900	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	4'100	500	3'600 CHF	102.60%	3'693'600.00	0.06	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	0	7'000	0	7'000 CHF	104.55%	7'318'500.00	0.11	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	7'195	0	7'195 CHF	106.45%	7'659'077.50	0.12	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	103.70%	2'799'900.00	0.04	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	2'000	0	2'000 CHF	101.20%	2'024'000.00	0.03	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	102.05%	2'245'100.00	0.03	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	0	2'300	0	2'300 CHF	102.95%	2'367'850.00	0.04	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	102.20%	2'657'200.00	0.04	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	0	2'660	0	2'660 CHF	104.45%	2'778'370.00	0.04	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	4'300	0	4'300 CHF	102.45%	4'405'350.00	0.07	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.30%	5'065'000.00	0.08	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	3'300	0	3'300 CHF	103.75%	3'423'750.00	0.05	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	4'200	0	4'200 CHF	105.45%	4'428'900.00	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.
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	4'900	0	4'900 CHF	105.30%	5'159'700.00	0.08	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	0	4'100	0	4'100 CHF	102.90%	4'218'900.00	0.06	a)
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	5'285	5'285	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887360	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 MAY	0	2'695	2'695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887378	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	2'100	0	2'100 CHF	101.30%	2'127'300.00	0.03	a)
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	0	2'500	0	2'500 CHF	101.30%	2'532'500.00	0.04	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	0	2'500	0	2'500 CHF	100.55%	2'513'750.00	0.04	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	1'110	0	1'110 CHF	130.95%	1'453'545.00	0.02	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	3'130	0	3'130 CHF	101.65%	3'181'645.00	0.05	a)
CH1266847115	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 JUN	0	3'940	3'940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	730	730	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	3'700	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1.625 04/07/26 JUL	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	5'300	0	5'300 CHF	103.11%	5'464'830.00	0.08	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	5'500	0	5'500 CHF	104.80%	5'764'000.00	0.09	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	1'400	0	1'400 CHF	100.90%	1'412'600.00	0.02	a)
CH1266847255	1.8000 % WKBSW 1.8 08/29/29	0	2'800	0	2'800 CHF	102.00%	2'856'000.00	0.04	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	0	6'500	0	6'500 CHF	102.44%	6'658'600.00	0.10	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	9'600	0	9'600 CHF	103.40%	9'926'400.00	0.15	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	6'400	0	6'400 CHF	104.59%	6'693'760.00	0.10	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	0	3'685	0	3'685 CHF	103.45%	3'812'132.50	0.06	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	3'700	300	3'400 CHF	101.90%	3'464'600.00	0.05	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	3'600	0	3'600 CHF	100.95%	3'634'200.00	0.06	a)
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	0	2'700	0	2'700 CHF	102.35%	2'763'450.00	0.04	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	1'300	0	1'300 CHF	100.85%	1'311'050.00	0.02	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	2'100	0	2'100 CHF	102.15%	2'145'150.00	0.03	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	1'480	0	1'480 CHF	101.45%	1'501'460.00	0.02	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	3'700	0	3'700 CHF	103.35%	3'823'950.00	0.06	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	1'750	0	1'750 CHF	102.65%	1'796'375.00	0.03	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	0.02	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	102.55%	2'973'950.00	0.05	a)
CH1271360575	1.7500 % AIB 1 3/4 06/26/30	0	2'100	0	2'100 CHF	103.00%	2'163'000.00	0.03	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	102.85%	2'262'700.00	0.03	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	0	2'800	0	2'800 CHF	102.00%	2'856'000.00	0.04	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	102.00%	1'938'000.00	0.03	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	2'620	0	2'620 CHF	104.00%	2'724'800.00	0.04	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	103.05%	4'122'000.00	0.06	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	0	300	0	300 CHF	104.75%	314'250.00	0.00	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	400	0	400 CHF	107.15%	428'600.00	0.01	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	1'000	0	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.02	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	0	1'700	0	1'700 CHF	102.25%	1'738'250.00	0.03	a)
CH1274703136	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47 SEPT	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	5'900	5'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	7'300	0	7'300 CHF	107.32%	7'834'360.00	0.12	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	3'200	0	3'200 CHF	109.10%	3'491'200.00	0.05	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	0	1'700	0	1'700 CHF	102.15%	1'736'550.00	0.03	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	5'900	0	5'900 CHF	102.40%	6'041'600.00	0.09	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	5'900	0	5'900 CHF	103.12%	6'084'080.00	0.09	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	4'890	500	4'390 CHF	103.35%	4'537'065.00	0.07	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'280	0	1'280 CHF	102.10%	1'306'880.00	0.02	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	104.95%	2'938'600.00	0.04	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	103.40%	2'481'600.00	0.04	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	104.75%	1'990'250.00	0.03	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	3'900	500	3'400 CHF	102.00%	3'468'000.00	0.05	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	1'500	300	1'200 CHF	105.50%	1'266'000.00	0.02	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	102.20%	1'941'800.00	0.03	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	101.70%	2'949'300.00	0.04	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	3'255	0	3'255 CHF	106.25%	3'458'437.50	0.05	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	0	2'600	0	2'600 CHF	103.30%	2'685'800.00	0.04	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.
CH1280154282	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 AUG	0	5'600	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	10'300	0	10'300 CHF	104.87%	10'801'610.00	0.16	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	4'500	0	4'500 CHF	102.31%	4'603'950.00	0.07	a)
CH1280154316	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 SEP	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	3'100	0	3'100 CHF	105.89%	3'282'590.00	0.05	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	0	2'000	0	2'000 CHF	101.55%	2'031'000.00	0.03	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	0	3'600	0	3'600 CHF	102.20%	3'679'200.00	0.06	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	5'100	0	5'100 CHF	101.55%	5'179'050.00	0.08	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	103.55%	1'242'600.00	0.02	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	102.10%	2'246'200.00	0.03	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	200	0	200 CHF	102.85%	205'700.00	0.00	a)
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	0	1'700	0	1'700 CHF	113.95%	1'937'150.00	0.03	a)
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	3'200	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	4'300	0	4'300 CHF	105.95%	4'555'850.00	0.07	a)
CH1290222434	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 OCT	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	0	5'300	0	5'300 CHF	102.88%	5'452'640.00	0.08	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'400	0	2'400 CHF	104.45%	2'506'800.00	0.04	a)
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	0	3'900	0	3'900 CHF	102.75%	4'007'250.00	0.06	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	0	1'900	0	1'900 CHF	106.00%	2'014'000.00	0.03	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	2'100	0	2'100 CHF	101.40%	2'129'400.00	0.03	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	0	1'700	0	1'700 CHF	103.65%	1'762'050.00	0.03	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	3'900	0	3'900 CHF	101.35%	3'952'650.00	0.06	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	102.70%	2'464'800.00	0.04	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	100.09%	1'901'710.00	0.03	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	905	0	905 CHF	100.81%	912'303.35	0.01	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIE 1.9 09/08/26	0	1'400	0	1'400 CHF	101.05%	1'414'700.00	0.02	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	102.00%	1'938'000.00	0.03	a)
CH1291278088	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41 SEP	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291809916	2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	0	1'700	0	1'700 CHF	101.70%	1'728'900.00	0.03	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	101.55%	3'046'500.00	0.05	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	103.05%	1'751'850.00	0.03	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	3'500	0	3'500 CHF	102.50%	3'587'500.00	0.05	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	101.70%	1'932'300.00	0.03	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'700	0	1'700 CHF	101.10%	1'718'700.00	0.03	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	1'600	0	1'600 CHF	102.70%	1'643'200.00	0.02	a)
CH1296291003	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 DEC	0	4'400	4'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291011	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 DEC	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291029	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 DEC	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291037	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 DEC	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	5'400	0	5'400 CHF	100.70%	5'437'800.00	0.08	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	6'800	0	6'800 CHF	103.45%	7'034'600.00	0.11	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	2'700	0	2'700 CHF	102.15%	2'758'050.00	0.04	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277782	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 NOV	0	6'300	6'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277790	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	4'200	0	4'200 CHF	104.13%	4'373'460.00	0.07	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	102.85%	1'645'600.00	0.03	a)
CH1305916749	1.5600 % AUCKCN 1.56 11/30/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.30%	2'026'000.00	0.03	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	4'200	0	4'200 CHF	101.60%	4'267'200.00	0.06	a)
CH1305916772	1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33	0	4'900	0	4'900 CHF	103.15%	5'054'350.00	0.08	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	4'700	0	4'700 CHF	105.90%	4'977'300.00	0.08	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	5'200	0	5'200 CHF	101.20%	5'262'400.00	0.08	a)
CH1305916848	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 DEC	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	3'900	3'900	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.
CH1305916889	2.2150 % GLENLN 2.215 01/18/30 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	100.70%	1'611'200.00	0.02	a)
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.45%	1'491'750.00	0.02	a)
CH1306117016	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 NOV	0	3'700	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	3'800	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117032	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 NOV	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	3'200	0	3'200 CHF	101.75%	3'256'000.00	0.05	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	0	960	0	960 CHF	101.75%	976'800.00	0.01	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	3'500	0	3'500 CHF	99.87%	3'495'450.00	0.05	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	2'600	0	2'600 CHF	99.72%	2'592'720.00	0.04	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	0	2'000	0	2'000 CHF	99.36%	1'987'200.00	0.03	a)
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	0	1'275	0	1'275 CHF	99.90%	1'273'725.00	0.02	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	720	0	720 CHF	98.80%	711'360.00	0.01	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	1'500	0	1'500 CHF	100.60%	1'509'000.00	0.02	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	0	5'200	0	5'200 CHF	102.01%	5'304'520.00	0.08	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	0	4'600	0	4'600 CHF	101.55%	4'671'300.00	0.07	a)
CH1310346254	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 JAN	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.10%	800'800.00	0.01	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	0	2'700	0	2'700 CHF	100.20%	2'705'400.00	0.04	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	2'000	0	2'000 CHF	100.80%	2'016'000.00	0.03	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	0	2'500	0	2'500 CHF	100.79%	2'519'625.00	0.04	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	0	6'500	0	6'500 CHF	101.51%	6'598'410.00	0.10	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	0	2'420	0	2'420 CHF	100.71%	2'437'182.00	0.04	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	0	3'800	0	3'800 CHF	100.66%	3'824'966.00	0.06	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	2'100	0	2'100 CHF	100.70%	2'114'763.00	0.03	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	100.10%	3'603'600.00	0.05	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	2'000	0	2'000 CHF	100.10%	2'002'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	3'400	0	3'400 CHF	100.30%	3'410'200.00	0.05	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	2'270	0	2'270 CHF	100.60%	2'283'620.00	0.03	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	2'000	0	2'000 CHF	100.42%	2'008'440.00	0.03	a)
CHF							5'190'297'628.95	78.90	

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

1'322'196'384.83 20.10

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

1'322'196'384.83 20.10

CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	0	30'938	30'938	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	13'066'022	5'285'885	4'552'565	13'799'342 CHF	95.82	1'322'196'384.83	20.10	a)
CHF							1'322'196'384.83	20.10	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	27'706'286.81	0.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	5'190'297'628.95	78.90
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'322'196'384.83	20.10
Sonstige Vermögenswerte	37'783'962.64	0.57
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'577'984'263.23	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-173'452.58	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	6'577'810'810.65	

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);	6'512'494'013.78	99.00
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	
ASTT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001
BVG 3 Index 45	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001
DT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001
FA CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001
GT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001
NT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.200	0.00 - 0.05	-	0.001

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
ASTT CHF	0.140	1.000	0.090	0.050	-
DT CHF	0.140	0.400	0.090	0.050	-
FA CHF	0.180	0.500	0.080	0.100	-
GT CHF	0.110	0.350	0.060	0.050	-
NT CHF	-	-	-	-	-

Periode: 01.02.2023 - 28.02.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.710	6.000	0.580	0.130	-

Periode: 01.03.2023 - 31.03.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.700	6.000	0.570	0.130	-

Periode: 03.04.2023 - 30.06.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

Periode: 03.07.2023 - 29.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.710	6.000	0.580	0.130	-

Periode: 02.10.2023 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.700	6.000	0.570	0.130	-

Periode: 01.11.2023 - 30.11.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

Periode: 01.12.2023 - 29.12.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
BVG 3 Index 45	0.710	6.000	0.580	0.130	-

Periode: 01.01.2024 - 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
BVG 3 Index 45	0.720	6.000	0.590	0.130	-

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 Index

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	0.65000	0.22750	0.42250

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
ASTT CHF 34)	Nein	CHF	0.77832	-	0.77832
BVG 3 Index 45 34)	Nein	CHF	0.23383	-	0.23383
DT CHF	Nein	CHF	0.76724	0.26853	0.49871
GT CHF	Nein	CHF	0.79589	0.27856	0.51733
NT CHF	Nein	CHF	0.89243	0.31235	0.58008

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: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

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 Referenzindexes 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 Referenzindexes 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 Bankwerkstage 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