

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB DOMESTIC CHF

## Jahresbericht per 29.02.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA CHF	31562124	CHF
GT CHF	33099984	CHF
NT CHF	11704507	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

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<sup>1</sup>
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible<sup>1</sup>
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible<sup>1</sup>
- ▶ 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 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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr<sup>1</sup>, 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 beigegeführten 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.

---

<sup>1</sup> Erfolgsrechnungen für den Zeitraum vom 31. Oktober 2022 bis 29. Februar 2024 für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

### **Beilage**

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	36
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	36
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	37
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	37
8	Pauschale Verwaltungskommission	38
9	Benchmark	38
10	TER	38
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	39
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	39
13	Fussnoten	39
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	40
15	Pflichtpublikationen	42

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'653'738'924.97	3'184'418'752.04	3'282'408'788.59	3'662'686'070.41
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'850'469.78	6'098'421.93	7'267'820.61	5'340'950.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		136'659.787	74'252.964	79'796.528	56'279.959
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		86.7151	82.1304	91.0794	94.8997
Ausschüttung je Anteil		0.75	0.80	0.60	0.60
Zwischenausschüttung je Anteil		-	-	-	0.05
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		66'824'177.66	41'007'763.38	45'480'423.67	48'868'087.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		721'392.257	470'716.101	472'969.491	489'558.636
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		92.6322	87.1178	96.1593	99.8207
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		97.2126	87.6476	93.3147	90.8409
Thesaurierung je Anteil		0.83	0.68	0.71	0.80
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'575'064'277.53	3'137'312'566.73	3'229'660'544.31	3'608'477'032.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		32'540'098.247	30'390'868.552	28'367'371.463	30'560'126.888
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		109.8664	103.2321	113.8512	118.0779
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		115.2989	103.8599	110.4833	107.4558
Thesaurierung je Anteil		1.13	0.96	1.00	1.11
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA CHF	6.60 %	7.93 %	-12.91 %	-2.21 %
Klasse GT CHF	6.62 %	7.95 %	-12.90 %	-2.19 %
Klasse NT CHF	6.77 %	8.10 %	-12.77 %	-2.05 %
Benchmark	6.62 %	7.96 %	-12.88 %	-2.16 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	0.07 %	0.06 %	0.09 %	0.05 %

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



## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse FA CHF	-0.02 %
Klasse GT CHF	-
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)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	7'832'492.95	5'016'604.24
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'618'283'331.10	3'157'445'285.14
Sonstige Vermögenswerte	27'631'851.57	21'962'051.14
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'653'747'675.62</b>	<b>3'184'423'940.52</b>
Andere Verbindlichkeiten	-8'750.65	-5'188.48
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'653'738'924.97</b>	<b>3'184'418'752.04</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		74'252.964	79'796.528
Ausgegebene Anteile		71'766.640	21'360.786
Zurückgenommene Anteile		-9'359.817	-26'904.350
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>136'659.787</b>	<b>74'252.964</b>

Klasse GT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		470'716.101	472'969.491
Ausgegebene Anteile		312'931.849	46'227.720
Zurückgenommene Anteile		-62'255.693	-48'481.110
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>721'392.257</b>	<b>470'716.101</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		30'390'868.552	28'367'371.463
Ausgegebene Anteile		5'937'224.800	3'484'136.545
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		493'225.621	1'010'558.228
Zurückgenommene Anteile		-2'356'650.294	-1'341'032.007
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-1'924'570.432	-1'130'165.677
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>32'540'098.247</b>	<b>30'390'868.552</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	22.03.2023	25'738'614.30	245'820.298
Klasse NT CHF	23.05.2023	4'492'308.75	42'700.444
Klasse NT CHF	30.05.2023	19'158'041.32	181'000.055
Klasse NT CHF	12.06.2023	2'502'937.85	23'704.824

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.06.2023	91'190'749.84	864'743.522
Klasse NT CHF	14.06.2023	91'359'523.13	868'654.521
Klasse NT CHF	10.11.2023	20'424'399.23	191'172.389

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'184'418'752.04	3'282'408'788.59
Ausbezahlte Ausschüttung		-72'330.77	-41'870.50
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-10'386'021.59	-10'498'864.06
Saldo aus dem Anteilverkehr		259'876'859.81	216'349'221.82
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		219'901'665.48	-303'798'523.81
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>3'653'738'924.97</b>	<b>3'184'418'752.04</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		95'795.70	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-80'956.12
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		35'253'832.69	28'426'258.50
Erträge der Reverse Repo		0.00	6'638.66
Erträge aus Wertpapierleihe		823'429.50	728'479.15
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'263'410.23	2'016'156.50
<b>Total Ertrag</b>		<b>39'436'468.12</b>	<b>31'096'576.69</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-93'914.64	-68'488.43
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'732'032.28	-1'387'370.72
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'825'946.92</b>	<b>-1'455'859.15</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>37'610'521.20</b>	<b>29'640'717.54</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-36'186'487.99	-30'561'904.58
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		2'425'412.42	1'516'179.89
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>3'849'445.63</b>	<b>594'992.79</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		216'052'219.85	-304'393'516.60
<b>Gesamterfolg</b>		<b>219'901'665.48</b>	<b>-303'798'523.81</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse FA CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	105'904.38	45'887.34
Vortrag des Vorjahres	2'051.79	15'566.82
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>107'956.17</b>	<b>61'454.16</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	102'494.84	59'402.37
Vortrag auf neue Rechnung	5'461.33	2'051.79
<b>Total</b>	<b>107'956.17</b>	<b>61'454.16</b>
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	599'230.17	323'812.60
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>599'230.17</b>	<b>323'812.60</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	209'730.56	113'334.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	389'499.61	210'478.19
<b>Total</b>	<b>599'230.17</b>	<b>323'812.60</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	36'905'386.65	29'271'017.60
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>36'905'386.65</b>	<b>29'271'017.60</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'916'885.33	10'244'856.16
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	23'988'501.32	19'026'161.44
<b>Total</b>	<b>36'905'386.65</b>	<b>29'271'017.60</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>3'618'283'331.10</b>	<b>99.03</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>3'618'283'331.10</b>	<b>99.03</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	48'408	6'952	5'000	50'360 CHF	112.56%	56'685'216.00	1.55	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	23'334	4'965	3'200	25'099 CHF	171.70%	43'094'983.00	1.18	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	31'874	9'800	800	40'874 CHF	123.29%	50'393'554.60	1.38	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	3'550	700	0	4'250 CHF	108.95%	4'630'375.00	0.13	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	5'140	500	3'450	2'190 CHF	101.23%	2'216'937.00	0.06	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	2'600	0	400	2'200 CHF	101.43%	2'231'460.00	0.06	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	2'160	0	0	2'160 CHF	101.75%	2'197'800.00	0.06	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	4'340	0	0	4'340 CHF	113.10%	4'908'540.00	0.13	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	950	200	0	1'150 CHF	102.20%	1'175'300.00	0.03	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	37'004	4'800	1'280	40'524 CHF	119.47%	48'414'022.80	1.33	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	8'810	1'500	1'100	9'210 CHF	103.65%	9'546'165.00	0.26	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	5'590	0	5'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031226134	3.2500 % PSYPO 3 1/4 06/15/27 424	1'360	1'800	0	3'160 CHF	106.13%	3'353'708.00	0.09	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	25'744	5'171	3'600	27'315 CHF	107.44%	29'347'236.00	0.80	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	1'300	0	0	1'300 CHF	101.14%	1'314'820.00	0.04	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	2'800	0	0	2'800 CHF	101.29%	2'836'120.00	0.08	a)
CH0111008048	2.6250 % PSYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'400	0	0	1'400 CHF	107.38%	1'503'320.00	0.04	a)
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	2'700	0	0	2'700 CHF	100.60%	2'716'200.00	0.07	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	2'125	200	0	2'325 CHF	103.95%	2'416'837.50	0.07	a)
CH0115967397	2.2500 % PSYPO 2 1/4 08/13/32 519	7'600	0	0	7'600 CHF	106.56%	8'098'560.00	0.22	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	3'920	500	0	4'420 CHF	100.75%	4'453'150.00	0.12	a)
CH0117076379	1.8750 % PSYPO 1 7/8 09/15/31 524	8'000	0	0	8'000 CHF	103.42%	8'273'600.00	0.23	a)
CH0117843745	2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30	1'790	900	0	2'690 CHF	105.30%	2'832'570.00	0.08	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	1'675	0	0	1'675 CHF	101.40%	1'698'450.00	0.05	a)
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	6'500	0	500	6'000 CHF	100.98%	6'058'800.00	0.17	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	500	0	0	500 CHF	104.35%	521'750.00	0.01	a)
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	800	0	0	800 CHF	108.00%	864'000.00	0.02	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	2'560	0	0	2'560 CHF	104.40%	2'672'640.00	0.07	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'440	600	0	2'040 CHF	103.70%	2'115'480.00	0.06	a)
CH0119983077	1.8750 % KBLUZE 1 7/8 11/26/35	1'800	0	0	1'800 CHF	103.20%	1'857'600.00	0.05	a)
CH0120168486	2.1250 % PSYPO 2 1/8 12/01/28 533	6'950	1'390	2'230	6'110 CHF	103.59%	6'329'349.00	0.17	a)
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'670	0	0	1'670 CHF	105.60%	1'763'520.00	0.05	a)
CH0120847899	2.1250 % SGKNSW 2 1/8 12/27/40	300	0	0	300 CHF	107.35%	322'050.00	0.01	a)
CH0122512152	2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26	1'480	0	0	1'480 CHF	101.70%	1'505'160.00	0.04	a)
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSYPO 2 1/2 02/16/27 544	3'520	480	500	3'500 CHF	103.35%	3'617'250.00	0.10	a)
CH0124338937	2.6250 % PSYPO 2 5/8 02/14/31 548	3'910	5'785	800	8'895 CHF	108.21%	9'625'279.50	0.26	a)
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	750	0	0	750 CHF	115.25%	864'375.00	0.02	a)
CH0126519047	2.5000 % PSYPO 2 1/2 03/30/26 552	4'200	0	0	4'200 CHF	102.32%	4'297'440.00	0.12	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	550	0	0	550 CHF	112.80%	620'400.00	0.02	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	820	0	0	820 CHF	117.20%	961'040.00	0.03	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	1'740	0	0	1'740 CHF	102.05%	1'775'670.00	0.05	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	26'763	6'600	3'400	29'963 CHF	110.15%	33'004'244.50	0.90	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	36'740	2'689	400	39'029 CHF	111.02%	43'329'995.80	1.19	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	27'934	0	27'934	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	35'315	4'290	3'700	35'905 CHF	105.49%	37'876'184.50	1.04	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	3'295	1'000	800	3'495 CHF	102.08%	3'567'696.00	0.10	a)
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	610	550	0	1'160 CHF	106.90%	1'240'040.00	0.03	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	680	200	0	880 CHF	108.15%	951'720.00	0.03	a)
CH0128891105	2.7500 % PSYPO 2 3/4 12/15/26 553	2'040	2'705	635	4'110 CHF	103.84%	4'267'824.00	0.12	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	1'495	0	0	1'495 CHF	116.45%	1'740'927.50	0.05	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	1'400	0	0	1'400 CHF	107.05%	1'498'700.00	0.04	a)
CH0130614883	2.3750 % LUCERN 2 3/8 06/15/27	350	185	0	535 CHF	103.80%	555'330.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0132163434	2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31	595	0	0	595 CHF	107.00%	636'650.00	0.02	a)
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	2'740	0	0	2'740 CHF	101.22%	2'773'428.00	0.08	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	260	1'340	0	1'600 CHF	101.20%	1'619'200.00	0.04	a)
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	3'730	2'300	1'600	4'430 CHF	100.99%	4'473'857.00	0.12	a)
CH0137992803	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41	0	1'100	0	1'100 CHF	106.45%	1'170'950.00	0.03	a)
CH0138276859	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 10/04/41	2'500	0	0	2'500 CHF	107.60%	2'690'000.00	0.07	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	1'810	1'500	3'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	1'700	0	0	1'700 CHF	100.35%	1'705'950.00	0.05	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	3'400	800	4'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	2'640	0	2'640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	1'500	695	940	1'255 CHF	100.85%	1'265'667.50	0.03	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	1'600	0	0	1'600 CHF	108.80%	1'740'800.00	0.05	a)
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	700	0	0	700 CHF	100.50%	703'500.00	0.02	a)
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	3'420	0	0	3'420 CHF	102.10%	3'491'820.00	0.10	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	1'900	300	0	2'200 CHF	100.05%	2'201'100.00	0.06	a)
CH0143808365	1.5000 % BVZNSW 1 1/2 04/12/32	150	800	0	950 CHF	101.40%	963'300.00	0.03	a)
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	4'200	1'295	400	5'095 CHF	100.66%	5'128'627.00	0.14	a)
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	2'055	0	0	2'055 CHF	100.25%	2'060'137.50	0.06	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	2'865	0	0	2'865 CHF	101.50%	2'907'975.00	0.08	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'700	250	600	1'350 CHF	100.35%	1'354'725.00	0.04	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42	1'145	0	0	1'145 CHF	109.90%	1'258'355.00	0.03	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	5'300	2'000	1'000	6'300 CHF	100.13%	6'308'190.00	0.17	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	700	1'700	0	2'400 CHF	101.80%	2'443'200.00	0.07	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	1'000	0	0	1'000 CHF	99.85%	998'500.00	0.03	a)
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	1'350	0	495	855 CHF	104.40%	892'620.00	0.02	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	910	0	0	910 CHF	100.60%	915'460.00	0.03	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	5'050	1'000	0	6'050 CHF	101.15%	6'119'575.00	0.17	a)
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	6'600	2'595	1'500	7'695 CHF	100.54%	7'736'553.00	0.21	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	29'042	7'700	3'400	33'342 CHF	100.50%	33'508'710.00	0.92	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	1'350	0	0	1'350 CHF	101.30%	1'367'550.00	0.04	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	2'240	495	400	2'335 CHF	100.70%	2'351'345.00	0.06	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	6'970	500	700	6'770 CHF	100.81%	6'824'837.00	0.19	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'150	250	0	1'400 CHF	99.85%	1'397'900.00	0.04	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	700	315	0	1'015 CHF	99.50%	1'009'925.00	0.03	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	1'250	200	0	1'450 CHF	100.05%	1'450'725.00	0.04	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	440	0	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0186472822	1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0187043820	1.3750 % SGKNSW 1 3/8 06/22/27	1'150	435	0	1'585 CHF	99.80%	1'581'830.00	0.04	a)
CH0188335365	1.7500 % SCMNVSX 1 3/4 07/10/24	4'400	0	4'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189742445	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 07/20/37	1'400	0	0	1'400 CHF	100.20%	1'402'800.00	0.04	a)
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	5'530	700	0	6'230 CHF	100.50%	6'261'150.00	0.17	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	5'190	300	500	4'990 CHF	100.14%	4'996'986.00	0.14	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'600	150	0	1'750 CHF	99.70%	1'744'750.00	0.05	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	8'700	305	1'000	8'005 CHF	100.20%	8'021'010.00	0.22	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	1'000	300	0	1'300 CHF	100.00%	1'300'000.00	0.04	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILI 3 09/27/52	1'200	0	0	1'200 CHF	111.80%	1'341'600.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	1'490	0	0	1'490 CHF	99.50%	1'482'550.00	0.04	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'350	0	0	1'350 CHF	99.95%	1'349'325.00	0.04	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	1'500	0	0	1'500 CHF	99.55%	1'493'250.00	0.04	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	2'850	0	0	2'850 CHF	100.15%	2'854'275.00	0.08	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	2'000	0	0	2'000 CHF	99.60%	1'992'000.00	0.05	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	2'750	0	0	2'750 CHF	102.70%	2'824'250.00	0.08	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25	1'660	0	450	1'210 CHF	100.18%	1'212'178.00	0.03	a)
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	870	0	0	870 CHF	100.10%	870'870.00	0.02	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	2'100	600	0	2'700 CHF	100.10%	2'702'700.00	0.07	a)
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	7'270	1'000	0	8'270 CHF	100.14%	8'281'578.00	0.23	a)
CH0204790759	1.5000 % SGKNSW 1 1/2 02/12/31	1'600	0	0	1'600 CHF	99.95%	1'599'200.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	2'900	0	0	2'900 CHF	99.95%	2'898'550.00	0.08	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	1'700	0	0	1'700 CHF	101.25%	1'721'250.00	0.05	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	800	0	0	800 CHF	103.40%	827'200.00	0.02	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	1'200	450	0	1'650 CHF	101.05%	1'667'325.00	0.05	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	2'950	0	500	2'450 CHF	99.81%	2'445'345.00	0.07	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	1'550	200	0	1'750 CHF	100.25%	1'754'375.00	0.05	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'195	600	0	1'795 CHF	105.30%	1'890'135.00	0.05	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	1'000	400	300	1'100 CHF	100.60%	1'106'600.00	0.03	a)
CH0208271541	3.0000 % KWLILI 3 04/02/48	1'200	0	0	1'200 CHF	111.75%	1'341'000.00	0.04	a)
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	1'800	785	0	2'585 CHF	103.65%	2'679'352.50	0.07	a)
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	1'200	0	0	1'200 CHF	101.00%	1'212'000.00	0.03	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	1'000	200	200	1'000 CHF	100.75%	1'007'500.00	0.03	a)
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	2'815	0	0	2'815 CHF	99.90%	2'812'185.00	0.08	a)
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	8'190	0	900	7'290 CHF	101.63%	7'408'827.00	0.20	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	1'950	600	500	2'050 CHF	103.80%	2'127'900.00	0.06	a)
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	650	0	0	650 CHF	102.30%	664'950.00	0.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'650	250	0	1'900 CHF	101.25%	1'923'750.00	0.05	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	940	0	0	940 CHF	106.50%	1'001'100.00	0.03	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	3'800	0	0	3'800 CHF	100.67%	3'825'460.00	0.10	a)
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	850	510	0	1'360 CHF	102.35%	1'391'960.00	0.04	a)
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	7'215	500	0	7'715 CHF	100.46%	7'750'489.00	0.21	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	1'650	650	0	2'300 CHF	102.35%	2'354'050.00	0.06	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	1'200	700	0	1'900 CHF	108.20%	2'055'800.00	0.06	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	1'150	0	0	1'150 CHF	101.20%	1'163'800.00	0.03	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	2'540	0	0	2'540 CHF	108.25%	2'749'550.00	0.08	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	3'000	0	0	3'000 CHF	100.73%	3'021'900.00	0.08	a)
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	1'300	0	0	1'300 CHF	107.25%	1'394'250.00	0.04	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	2'100	100	180	2'020 CHF	101.35%	2'047'270.00	0.06	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	1'800	200	0	2'000 CHF	105.25%	2'105'000.00	0.06	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	28'717	8'700	3'700	33'717 CHF	100.51%	33'888'956.70	0.93	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	30'066	2'900	3'100	29'866 CHF	148.54%	44'362'956.40	1.21	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	30'703	6'130	4'275	32'558 CHF	98.17%	31'962'188.60	0.87	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	17'443	3'200	0	20'643 CHF	93.55%	19'311'526.50	0.53	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	39'614	8'718	6'200	42'132 CHF	95.64%	40'295'044.80	1.10	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	4'315	600	300	4'615 CHF	107.00%	4'938'050.00	0.14	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	1'130	0	0	1'130 CHF	106.25%	1'200'625.00	0.03	a)
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	400	500	0	900 CHF	100.30%	902'700.00	0.02	a)
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0228138274	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/38	0	300	0	300 CHF	108.75%	326'250.00	0.01	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	0	900	0	900 CHF	111.15%	1'000'350.00	0.03	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26	1'600	0	0	1'600 CHF	101.75%	1'628'000.00	0.04	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	500	0	0	500 CHF	110.65%	553'250.00	0.02	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	2'000	1'000	0	3'000 CHF	106.15%	3'184'500.00	0.09	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	2'100	1'000	400	2'700 CHF	111.05%	2'998'350.00	0.08	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	750	0	0	750 CHF	110.50%	828'750.00	0.02	a)
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	6'550	2'500	1'500	7'550 CHF	100.62%	7'596'810.00	0.21	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	2'310	0	2'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	1'150	0	0	1'150 CHF	102.55%	1'179'325.00	0.03	a)
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	1'180	0	1'180	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	1'290	250	0	1'540 CHF	112.33%	1'729'882.00	0.05	a)
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	6'670	0	6'670	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109618	1.8750 % GZOWTZ 1 7/8 06/12/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	2'000	750	2'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	1'400	0	0	1'400 CHF	100.25%	1'403'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	6'100	0	600	5'500 CHF	100.21%	5'511'550.00	0.15	a)
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	1'085	0	1'085	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	1'350	0	0	1'350 CHF	100.80%	1'360'800.00	0.04	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	1'985	0	1'985	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	2'800	1'500	0	4'300 CHF	100.73%	4'331'390.00	0.12	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	0	0	1'000 CHF	100.25%	1'002'500.00	0.03	a)
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'200	400	0	2'600 CHF	101.90%	2'649'400.00	0.07	a)
CH0247776138	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 07/14/26	2'000	0	315	1'685 CHF	100.20%	1'688'370.00	0.05	a)
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	2'590	0	2'590	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	6'130	0	6'130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	1'000	315	460	855 CHF	99.30%	849'015.00	0.02	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	1'000	0	0	1'000 CHF	100.20%	1'002'000.00	0.03	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252379802	1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	1'180	140	0	1'320 CHF	99.90%	1'318'680.00	0.04	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'700	0	0	2'700 CHF	99.45%	2'685'150.00	0.07	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	2'790	500	0	3'290 CHF	101.20%	3'329'480.00	0.09	a)
CH0253243346	0.7500 % EGW 0 3/4 09/24/24 49	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	1'550	0	0	1'550 CHF	99.45%	1'541'475.00	0.04	a)
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	5'850	0	5'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	1'000	1'150	0	2'150 CHF	99.40%	2'137'100.00	0.06	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	1'700	0	400	1'300 CHF	99.80%	1'297'400.00	0.04	a)
CH0253613548	1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254147504	1.5000 % SCMN VX 1 1/2 09/28/29	1'850	0	500	1'350 CHF	100.75%	1'360'125.00	0.04	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	2'680	0	500	2'180 CHF	99.35%	2'165'830.00	0.06	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	1'835	0	1'835	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	2'300	1'050	0	3'350 CHF	99.22%	3'323'870.00	0.09	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	3'000	4'250	500	6'750 CHF	99.65%	6'726'375.00	0.18	a)
CH0255893122	1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25	1'200	150	0	1'350 CHF	99.81%	1'347'435.00	0.04	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	8'165	0	8'165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0257754561	0.7500 % TESSIN 0 3/4 11/13/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	4'800	0	4'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	630	1'000	0	1'630 CHF	100.27%	1'634'401.00	0.04	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	3'340	0	0	3'340 CHF	99.50%	3'323'300.00	0.09	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	840	0	840	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	1'205	0	0	1'205 CHF	99.52%	1'199'216.00	0.03	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	1'750	0	200	1'550 CHF	99.20%	1'537'600.00	0.04	a)
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	2'590	0	0	2'590 CHF	100.34%	2'598'806.00	0.07	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'900	500	0	2'400 CHF	96.50%	2'316'000.00	0.06	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	2'300	0	0	2'300 CHF	98.55%	2'266'650.00	0.06	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	1'250	0	0	1'250 CHF	99.30%	1'241'250.00	0.03	a)
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	900	0	0	900 CHF	99.57%	896'130.00	0.02	a)
CH0262888941	0.8750 % VBPSW 0 7/8 10/07/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	9'775	1'300	1'230	9'845 CHF	98.50%	9'697'325.00	0.27	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	8'565	0	0	8'565 CHF	99.13%	8'490'484.50	0.23	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	3'550	0	500	3'050 CHF	99.06%	3'021'330.00	0.08	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	1'050	0	0	1'050 CHF	95.00%	997'500.00	0.03	a)
CH0266836144	0.1250 % TESSIN 0 1/8 03/06/25	500	0	0	500 CHF	98.63%	493'150.00	0.01	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	6'900	500	0	7'400 CHF	94.57%	6'998'180.00	0.19	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	1'850	150	0	2'000 CHF	97.85%	1'957'000.00	0.05	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	1'450	0	0	1'450 CHF	92.05%	1'334'725.00	0.04	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	1'250	0	395	855 CHF	98.65%	843'457.50	0.02	a)
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	2'490	0	385	2'105 CHF	91.90%	1'934'495.00	0.05	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	5'570	2'500	0	8'070 CHF	95.93%	7'741'551.00	0.21	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35	3'740	0	1'215	2'525 CHF	94.25%	2'379'812.50	0.07	a)
CH0269382088	0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30	1'200	500	400	1'300 CHF	95.10%	1'236'300.00	0.03	a)
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	2'100	500	700	1'900 CHF	96.80%	1'839'200.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	1'150	0	0	1'150 CHF	96.80%	1'113'200.00	0.03	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	795	250	0	1'045 CHF	95.55%	998'497.50	0.03	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	1'900	250	0	2'150 CHF	96.60%	2'076'900.00	0.06	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	4'305	0	0	4'305 CHF	98.61%	4'245'160.50	0.12	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	4'815	345	400	4'760 CHF	96.15%	4'576'740.00	0.13	a)
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	3'085	0	0	3'085 CHF	95.65%	2'950'802.50	0.08	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'700	900	0	2'600 CHF	94.10%	2'446'600.00	0.07	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	750	0	0	750 CHF	95.70%	717'750.00	0.02	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	9'525	1'415	3'165	7'775 CHF	96.66%	7'515'315.00	0.21	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	3'200	1'570	0	4'770 CHF	93.97%	4'482'369.00	0.12	a)
CH0271737097	0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25	700	0	0	700 CHF	98.86%	692'020.00	0.02	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	1'385	300	0	1'685 CHF	97.20%	1'637'820.00	0.04	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	1'200	0	0	1'200 CHF	94.85%	1'138'200.00	0.03	a)
CH027347838	1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25	900	0	0	900 CHF	99.49%	895'410.00	0.02	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	8'200	2'350	4'800	5'750 CHF	98.92%	5'687'900.00	0.16	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	8'050	0	0	8'050 CHF	96.34%	7'755'370.00	0.21	a)
CH0274253514	0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27	1'545	750	300	1'995 CHF	97.30%	1'941'135.00	0.05	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'050	1'355	800	1'605 CHF	97.35%	1'562'467.50	0.04	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'000	0	200	1'800 CHF	98.74%	1'777'320.00	0.05	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'530	400	0	1'930 CHF	96.85%	1'869'205.00	0.05	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	2'320	0	0	2'320 CHF	95.85%	2'223'720.00	0.06	a)
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	0	1'405	0	1'405 CHF	98.40%	1'382'520.00	0.04	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	6'465	1'000	0	7'465 CHF	93.10%	6'949'915.00	0.19	a)
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	8'860	0	8'860	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	6'350	1'000	750	6'600 CHF	95.03%	6'271'980.00	0.17	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	2'150	0	0	2'150 CHF	96.50%	2'074'750.00	0.06	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	1'250	500	0	1'750 CHF	98.48%	1'723'400.00	0.05	a)
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	1'750	190	700	1'240 CHF	91.65%	1'136'460.00	0.03	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	6'440	600	0	7'040 CHF	92.47%	6'509'888.00	0.18	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	2'400	0	900	1'500 CHF	98.47%	1'477'050.00	0.04	a)
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	2'100	0	300	1'800 CHF	94.90%	1'708'200.00	0.05	a)
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	1'090	300	0	1'390 CHF	98.79%	1'373'181.00	0.04	a)
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'200	0	0	1'200 CHF	99.50%	1'194'000.00	0.03	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	2'105	0	2'105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	4'920	230	0	5'150 CHF	92.84%	4'781'260.00	0.13	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	3'810	0	0	3'810 CHF	91.50%	3'486'150.00	0.10	a)
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	1'650	0	0	1'650 CHF	95.85%	1'581'525.00	0.04	a)
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	3'000	0	0	3'000 CHF	98.67%	2'960'100.00	0.08	a)
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	5'415	0	5'415	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	4'800	2'000	1'000	5'800 CHF	96.87%	5'618'460.00	0.15	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	3'050	0	0	3'050 CHF	94.18%	2'872'490.00	0.08	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	1'600	0	600	1'000 CHF	98.82%	988'200.00	0.03	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	400	0	0	400 CHF	97.05%	388'200.00	0.01	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	7'650	0	0	7'650 CHF	97.73%	7'476'345.00	0.20	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'800	0	0	1'800 CHF	98.80%	1'778'400.00	0.05	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	8'200	250	0	8'450 CHF	98.74%	8'343'530.00	0.23	a)
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	810	300	0	1'110 CHF	98.80%	1'096'680.00	0.03	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	6'535	0	0	6'535 CHF	98.15%	6'414'102.50	0.18	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	400	700	0	1'100 CHF	94.35%	1'037'850.00	0.03	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	7'850	0	0	7'850 CHF	94.90%	7'449'650.00	0.20	a)
CH0293343411	0.4000 % WKBSNW 0.4 09/15/25	1'700	0	600	1'100 CHF	98.25%	1'080'750.00	0.03	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	5'250	0	0	5'250 CHF	98.43%	5'167'575.00	0.14	a)
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	7'000	0	0	7'000 CHF	98.37%	6'885'900.00	0.19	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	7'000	0	2'000	5'000 CHF	94.84%	4'742'000.00	0.13	a)
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	1'500	0	0	1'500 CHF	95.15%	1'427'250.00	0.04	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	3'100	0	0	3'100 CHF	95.30%	2'954'300.00	0.08	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	3'020	0	200	2'820 CHF	98.35%	2'773'470.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	1'240	0	1'240	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	5'970	0	5'970	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	4'590	0	0	4'590 CHF	95.34%	4'376'106.00	0.12	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	6'625	500	0	7'125 CHF	95.76%	6'822'900.00	0.19	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	3'090	0	3'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	2'440	0	0	2'440 CHF	95.10%	2'320'440.00	0.06	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'650	1'200	600	2'250 CHF	96.50%	2'171'250.00	0.06	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	7'850	0	570	7'280 CHF	93.15%	6'781'320.00	0.19	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	500	0	0	500 CHF	96.25%	481'250.00	0.01	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	1'350	0	0	1'350 CHF	94.65%	1'277'775.00	0.03	a)
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	5'405	0	0	5'405 CHF	97.60%	5'275'280.00	0.14	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	8'550	750	750	8'550 CHF	94.66%	8'093'430.00	0.22	a)
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	1'345	0	0	1'345 CHF	99.30%	1'335'585.00	0.04	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	2'150	1'500	1'595	2'055 CHF	100.70%	2'069'385.00	0.06	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	7'030	0	0	7'030 CHF	95.84%	6'737'552.00	0.18	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	2'530	0	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	8'290	0	0	8'290 CHF	90.67%	7'516'543.00	0.21	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	8'030	710	700	8'040 CHF	97.57%	7'844'628.00	0.21	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	1'400	0	0	1'400 CHF	99.00%	1'386'000.00	0.04	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRI 0 1/2 02/23/28	2'400	200	300	2'300 CHF	96.05%	2'209'150.00	0.06	a)
CH0311427618	0.2000 % WKBSW 0.2 08/19/24	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512640	0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28	1'950	0	240	1'710 CHF	95.30%	1'629'630.00	0.04	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	2'800	0	300	2'500 CHF	98.77%	2'469'250.00	0.07	a)
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	7'160	0	0	7'160 CHF	91.12%	6'524'192.00	0.18	a)
CH0312512723	0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	1'450	0	0	1'450 CHF	89.05%	1'291'225.00	0.04	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	1'000	1'000	400	1'600 CHF	97.60%	1'561'600.00	0.04	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	3'895	0	0	3'895 CHF	89.20%	3'474'340.00	0.10	a)
CH0317921663	0.3750 % SCMNVS 0 3/8 03/31/28	1'500	235	0	1'735 CHF	95.95%	1'664'732.50	0.05	a)
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	8'145	650	840	7'955 CHF	96.66%	7'689'303.00	0.21	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	2'700	0	0	2'700 CHF	97.10%	2'621'700.00	0.07	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKBK 0 1/4 05/27/26	850	0	0	850 CHF	97.15%	825'775.00	0.02	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'800	0	0	1'800 CHF	97.20%	1'749'600.00	0.05	a)
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	8'230	900	500	8'630 CHF	92.60%	7'991'380.00	0.22	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	8'540	0	0	8'540 CHF	94.74%	8'090'796.00	0.22	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	5'200	0	0	5'200 CHF	92.41%	4'805'320.00	0.13	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	8'215	0	2'500	5'715 CHF	89.76%	5'129'784.00	0.14	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFS 0 7/8 05/12/26	1'200	0	0	1'200 CHF	98.65%	1'183'800.00	0.03	a)
CH0319415987	0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26	2'050	0	0	2'050 CHF	97.65%	2'001'825.00	0.05	a)
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.30%	963'000.00	0.03	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'200	0	0	2'200 CHF	90.60%	1'993'200.00	0.05	a)
CH0319932767	0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31	1'440	0	0	1'440 CHF	91.35%	1'315'440.00	0.04	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	2'750	0	0	2'750 CHF	98.47%	2'707'925.00	0.07	a)
CH0320712604	0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31	1'000	185	0	1'185 CHF	92.80%	1'099'680.00	0.03	a)
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	2'130	0	0	2'130 CHF	92.20%	1'963'860.00	0.05	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	6'850	500	1'000	6'350 CHF	95.59%	6'069'965.00	0.17	a)
CH0326213912	0.2500 % KISPZ 0 1/4 07/28/28	900	400	0	1'300 CHF	94.50%	1'228'500.00	0.03	a)
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	3'600	0	0	3'600 CHF	83.65%	3'011'400.00	0.08	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPZ 0 3/4 07/28/36	1'600	0	200	1'400 CHF	87.65%	1'227'100.00	0.03	a)
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	1'100	0	0	1'100 CHF	98.00%	1'078'000.00	0.03	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	4'800	900	0	5'700 CHF	84.96%	4'842'720.00	0.13	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	2'700	0	0	2'700 CHF	98.05%	2'647'350.00	0.07	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'445	0	0	2'445 CHF	80.65%	1'971'892.50	0.05	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	3'100	0	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	2'700	0	0	2'700 CHF	95.40%	2'575'800.00	0.07	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	4'900	1'500	0	6'400 CHF	84.15%	5'385'600.00	0.15	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	750	0	0	750 CHF	97.90%	734'250.00	0.02	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	900	0	0	900 CHF	91.00%	819'000.00	0.02	a)
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	1'050	500	0	1'550 CHF	97.10%	1'505'050.00	0.04	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	1'500	0	0	1'500 CHF	93.70%	1'405'500.00	0.04	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	2'680	0	0	2'680 CHF	91.24%	2'445'232.00	0.07	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	3'700	0	500	3'200 CHF	82.30%	2'633'600.00	0.07	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	5'100	0	900	4'200 CHF	79.26%	3'328'920.00	0.09	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMN VX 0 1/8 09/15/32	2'600	0	0	2'600 CHF	89.20%	2'319'200.00	0.06	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	8'150	0	8'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	6'650	500	0	7'150 CHF	96.24%	6'881'160.00	0.19	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	3'000	4'500	0	7'500 CHF	91.06%	6'829'500.00	0.19	a)
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	3'200	0	0	3'200 CHF	90.05%	2'881'600.00	0.08	a)
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	2'420	0	0	2'420 CHF	98.00%	2'371'600.00	0.06	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	4'600	0	0	4'600 CHF	96.64%	4'445'440.00	0.12	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	4'950	0	0	4'950 CHF	89.67%	4'438'665.00	0.12	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	6'960	0	0	6'960 CHF	81.41%	5'666'136.00	0.16	a)
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	1'800	1'100	0	2'900 CHF	96.65%	2'802'850.00	0.08	a)
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	4'990	160	0	5'150 CHF	86.10%	4'434'150.00	0.12	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	2'785	0	1'000	1'785 CHF	93.85%	1'675'222.50	0.05	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	1'400	0	0	1'400 CHF	95.75%	1'340'500.00	0.04	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	2'040	0	0	2'040 CHF	81.30%	1'658'520.00	0.05	a)
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	2'050	0	0	2'050 CHF	77.65%	1'591'825.00	0.04	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	2'000	2'000	1'000	3'000 CHF	96.35%	2'890'500.00	0.08	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	700	0	0	700 CHF	81.20%	568'400.00	0.02	a)
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	1'500	0	1'000	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.01	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'500	0	0	1'500 CHF	90.95%	1'364'250.00	0.04	a)
CH0344583783	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 12/15/27	1'300	0	0	1'300 CHF	96.35%	1'252'550.00	0.03	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	6'850	1'250	1'500	6'600 CHF	98.61%	6'508'260.00	0.18	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	8'050	0	6'000	2'050 CHF	98.95%	2'028'475.00	0.06	a)
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	6'350	0	0	6'350 CHF	95.66%	6'074'410.00	0.17	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	900	0	0	900 CHF	93.45%	841'050.00	0.02	a)
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	700	0	0	700 CHF	95.20%	666'400.00	0.02	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	750	0	0	750 CHF	96.40%	723'000.00	0.02	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	18'083	11'500	2'900	26'683 CHF	93.25%	24'881'897.50	0.68	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	29'600	3'980	980	32'600 CHF	93.68%	30'539'680.00	0.84	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	28'162	5'422	2'900	30'684 CHF	97.36%	29'873'942.40	0.82	a)
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	3'800	600	900	3'500 CHF	97.75%	3'421'250.00	0.09	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	1'300	0	0	1'300 CHF	96.55%	1'255'150.00	0.03	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	1'750	320	365	1'705 CHF	96.20%	1'640'210.00	0.04	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	7'980	850	0	8'830 CHF	98.46%	8'694'018.00	0.24	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	5'000	400	0	5'400 CHF	96.26%	5'198'040.00	0.14	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	5'300	65	0	5'365 CHF	90.16%	4'837'084.00	0.13	a)
CH0350030422	0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26	850	0	0	850 CHF	98.10%	833'850.00	0.02	a)
CH0352419615	0.6250 % SGKNSW 0 5/8 01/23/32 2032	2'100	0	0	2'100 CHF	93.25%	1'958'250.00	0.05	a)
CH0352595851	0.2000 % WKBNSW 0.2 02/02/26	2'240	250	0	2'490 CHF	97.50%	2'427'750.00	0.07	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	5'950	1'050	0	7'000 CHF	96.72%	6'770'400.00	0.19	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	6'750	0	0	6'750 CHF	93.28%	6'296'400.00	0.17	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	3'000	250	0	3'250 CHF	97.95%	3'183'375.00	0.09	a)
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	2'200	500	500	2'200 CHF	96.00%	2'112'000.00	0.06	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	2'900	0	0	2'900 CHF	95.35%	2'765'150.00	0.08	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'000	0	0	1'000 CHF	94.10%	941'000.00	0.03	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	4'250	300	0	4'550 CHF	96.50%	4'390'750.00	0.12	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353688929	0.1100 % KBAARG 0.11 02/21/24	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	2'050	400	0	2'450 CHF	97.00%	2'376'500.00	0.07	a)
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'500	0	0	2'500 CHF	97.80%	2'445'000.00	0.07	a)
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	950	950	800	1'100 CHF	97.40%	1'071'400.00	0.03	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	1'300	315	300	1'315 CHF	97.15%	1'277'522.50	0.03	a)
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	5'600	0	5'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	7'300	750	1'200	6'850 CHF	97.43%	6'673'955.00	0.18	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	8'400	2'000	0	10'400 CHF	95.47%	9'928'880.00	0.27	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	700	200	0	900 CHF	97.80%	880'200.00	0.02	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	1'500	0	0	1'500 CHF	89.85%	1'347'750.00	0.04	a)
CH0358654975	0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024	5'650	0	5'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	3'100	500	200	3'400 CHF	95.95%	3'262'300.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	7'650	1'415	0	9'065 CHF	96.97%	8'790'330.50	0.24	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	2'500	150	200	2'450 CHF	96.75%	2'370'375.00	0.06	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	3'400	500	800	3'100 CHF	98.15%	3'042'650.00	0.08	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	8'000	0	0	8'000 CHF	96.59%	7'727'200.00	0.21	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	3'100	0	0	3'100 CHF	95.15%	2'949'650.00	0.08	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	2'950	0	2'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	1'000	340	300	1'040 CHF	92.80%	965'120.00	0.03	a)
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	4'100	1'700	0	5'800 CHF	97.65%	5'663'700.00	0.16	a)
CH0361532952	1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'000	0	0	1'000 CHF	92.90%	929'000.00	0.03	a)
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	3'600	2'650	0	6'250 CHF	98.06%	6'128'750.00	0.17	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	1'000	0	0	1'000 CHF	92.00%	920'000.00	0.03	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	1'200	250	0	1'450 CHF	96.50%	1'399'250.00	0.04	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	1'000	0	200	800 CHF	89.20%	713'600.00	0.02	a)
CH0361677260	0.2000 % KBLUZE 0.2 04/11/25	2'500	250	0	2'750 CHF	98.52%	2'709'300.00	0.07	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	1'000	0	0	1'000 CHF	90.10%	901'000.00	0.02	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	5'650	0	5'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	3'500	0	0	3'500 CHF	91.62%	3'206'700.00	0.09	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMN VX 0 3/8 05/31/27	2'800	0	0	2'800 CHF	96.95%	2'714'600.00	0.07	a)
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	2'050	0	0	2'050 CHF	89.40%	1'832'700.00	0.05	a)
CH0367206700	1.0000 % GALESW 1 12/15/26	970	540	0	1'510 CHF	98.45%	1'486'595.00	0.04	a)
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	1'250	0	0	1'250 CHF	98.25%	1'228'125.00	0.03	a)
CH0367206742	0.7000 % LONNVX 0.7 07/12/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'800	150	200	1'750 CHF	95.85%	1'677'375.00	0.05	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	800	1'050	345	1'505 CHF	94.50%	1'422'225.00	0.04	a)
CH0368697717	1.1250 % BCG 1 1/8 06/28/27	800	0	0	800 CHF	97.55%	780'400.00	0.02	a)
CH0368697758	0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29	300	500	0	800 CHF	94.80%	758'400.00	0.02	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	4'600	700	0	5'300 CHF	97.22%	5'152'660.00	0.14	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	3'100	0	965	2'135 CHF	88.07%	1'880'294.50	0.05	a)
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	750	0	0	750 CHF	94.35%	707'625.00	0.02	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	2'450	0	800	1'650 CHF	98.05%	1'617'825.00	0.04	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	8'730	0	600	8'130 CHF	95.90%	7'796'670.00	0.21	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	950	0	0	950 CHF	90.90%	863'550.00	0.02	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	1'215	0	350	865 CHF	97.40%	842'510.00	0.02	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMN VX 0 3/4 11/24/33	1'950	0	0	1'950 CHF	92.90%	1'811'550.00	0.05	a)
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	7'680	500	0	8'180 CHF	96.07%	7'858'526.00	0.22	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	1'100	700	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	1'250	0	0	1'250 CHF	97.55%	1'219'375.00	0.03	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	1'000	0	0	1'000 CHF	92.80%	928'000.00	0.03	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	3'450	300	200	3'550 CHF	95.75%	3'399'125.00	0.09	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	1'100	0	300	800 CHF	92.25%	738'000.00	0.02	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	8'125	400	0	8'525 CHF	96.63%	8'237'707.50	0.23	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	5'500	1'100	0	6'600 CHF	93.57%	6'175'620.00	0.17	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	1'400	600	290	1'710 CHF	97.70%	1'670'670.00	0.05	a)
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	1'400	0	0	1'400 CHF	97.60%	1'366'400.00	0.04	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	2'850	0	0	2'850 CHF	98.50%	2'807'250.00	0.08	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	9'430	1'700	2'260	8'870 CHF	96.20%	8'532'940.00	0.23	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	1'400	0	300	1'100 CHF	95.90%	1'054'900.00	0.03	a)
CH0373476776	0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	1'200	0	0	1'200 CHF	96.00%	1'152'000.00	0.03	a)
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	2'700	0	0	2'700 CHF	98.88%	2'669'760.00	0.07	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	2'250	150	200	2'200 CHF	98.31%	2'162'820.00	0.06	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	3'950	0	0	3'950 CHF	94.13%	3'718'135.00	0.10	a)
CH0373476974	1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26	800	0	0	800 CHF	98.15%	785'200.00	0.02	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	8'525	0	1'000	7'525 CHF	96.16%	7'236'040.00	0.20	a)
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	2'300	620	515	2'405 CHF	96.10%	2'311'205.00	0.06	a)
CH0379268706	0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27	1'800	0	0	1'800 CHF	95.40%	1'717'200.00	0.05	a)
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.50%	1'930'000.00	0.05	a)
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	1'250	500	0	1'750 CHF	97.75%	1'710'625.00	0.05	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	2'200	0	0	2'200 CHF	97.10%	2'136'200.00	0.06	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	1'500	355	0	1'855 CHF	89.65%	1'663'007.50	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	1'200	0	450	750 CHF	90.05%	675'375.00	0.02	a)
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	6'000	310	770	5'540 CHF	97.31%	5'390'974.00	0.15	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	3'300	0	0	3'300 CHF	95.38%	3'147'540.00	0.09	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	1'650	0	0	1'650 CHF	90.50%	1'493'250.00	0.04	a)
CH0384125115	0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125123	0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.00%	960'000.00	0.03	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'500	300	0	2'800 CHF	98.55%	2'759'400.00	0.08	a)
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	1'900	0	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	3'800	0	0	3'800 CHF	96.40%	3'663'200.00	0.10	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'900	500	600	1'800 CHF	93.90%	1'690'200.00	0.05	a)
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	875	0	0	875 CHF	97.55%	853'562.50	0.02	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	1'650	0	800	850 CHF	95.95%	815'575.00	0.02	a)
CH0389606085	0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26	2'200	0	0	2'200 CHF	96.95%	2'132'900.00	0.06	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	1'250	0	0	1'250 CHF	97.70%	1'221'250.00	0.03	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	1'750	0	0	1'750 CHF	99.90%	1'748'250.00	0.05	a)
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	2'800	0	665	2'135 CHF	95.40%	2'036'790.00	0.06	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	6'200	300	0	6'500 CHF	97.69%	6'349'850.00	0.17	a)
CH0392885791	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 08/07/24	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	2'000	0	0	2'000 CHF	95.30%	1'906'000.00	0.05	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'450	0	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	2'250	0	400	1'850 CHF	98.00%	1'813'000.00	0.05	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	2'500	0	0	2'500 CHF	96.65%	2'416'250.00	0.07	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	3'400	0	1'410	1'990 CHF	99.15%	1'973'085.00	0.05	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	4'000	0	0	4'000 CHF	98.52%	3'940'800.00	0.11	a)
CH0398633336	0.3500 % WKBSNW 0.35 09/07/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.05%	1'440'750.00	0.04	a)
CH0398633344	0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.03	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	1'600	0	235	1'365 CHF	97.10%	1'325'415.00	0.04	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	700	0	0	700 CHF	96.85%	677'950.00	0.02	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	800	0	0	800 CHF	95.65%	765'200.00	0.02	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	1'600	900	750	1'750 CHF	97.47%	1'705'725.00	0.05	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	6'150	0	500	5'650 CHF	94.71%	5'351'115.00	0.15	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	1'700	250	0	1'950 CHF	98.60%	1'922'700.00	0.05	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	1'410	0	0	1'410 CHF	98.55%	1'389'555.00	0.04	a)
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	1'900	0	190	1'710 CHF	98.20%	1'679'220.00	0.05	a)
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	4'700	0	4'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	5'350	3'300	0	8'650 CHF	96.61%	8'356'765.00	0.23	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	600	0	0	600 CHF	97.05%	582'300.00	0.02	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	1'700	0	500	1'200 CHF	95.75%	1'149'000.00	0.03	a)
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	2'150	250	0	2'400 CHF	96.40%	2'313'600.00	0.06	a)
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	2'150	0	1'000	1'150 CHF	97.40%	1'120'100.00	0.03	a)
CH0398633922	0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32	2'100	0	0	2'100 CHF	90.90%	1'908'900.00	0.05	a)
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	555	0	555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'200	320	500	1'020 CHF	96.20%	981'240.00	0.03	a)
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	1'950	400	500	1'850 CHF	97.40%	1'801'900.00	0.05	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	3'900	1'000	0	4'900 CHF	96.95%	4'750'550.00	0.13	a)
CH0400971617	0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24	2'900	0	2'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	750	500	500	750 CHF	95.10%	713'250.00	0.02	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'350	0	0	1'350 CHF	96.45%	1'302'075.00	0.04	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	2'150	0	350	1'800 CHF	95.60%	1'720'800.00	0.05	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	900	800	0	1'700 CHF	98.59%	1'676'030.00	0.05	a)
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	5'800	0	5'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'250	0	0	1'250 CHF	98.61%	1'232'625.00	0.03	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	1'500	0	600	900 CHF	98.40%	885'600.00	0.02	a)
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	97.85%	2'054'850.00	0.06	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	900	0	0	900 CHF	98.56%	887'040.00	0.02	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	2'100	0	0	2'100 CHF	98.75%	2'073'750.00	0.06	a)
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.03	a)
CH0409938153	0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24	1'350	0	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	4'400	0	4'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	3'700	0	1'815	1'885 CHF	97.00%	1'828'450.00	0.05 a)	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	1'225	200	0	1'425 CHF	96.85%	1'380'112.50	0.04 a)	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	1'100	250	0	1'350 CHF	94.55%	1'276'425.00	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	
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	2'650	0	0	2'650 CHF	95.80%	2'538'700.00	0.07 a)	
CH0419040735	0.3000 % WKBNWS 0.3 02/01/27	1'000	315	0	1'315 CHF	96.55%	1'269'632.50	0.03 a)	
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	1'100	0	0	1'100 CHF	100.05%	1'100'550.00	0.03 a)	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	1'300	1'500	1'000	1'800 CHF	94.55%	1'701'900.00	0.05 a)	
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	2'900	0	0	2'900 CHF	96.10%	2'786'900.00	0.08 a)	
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	1'950	150	270	1'830 CHF	97.65%	1'786'995.00	0.05 a)	
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	1'000	0	0	1'000 CHF	95.15%	951'500.00	0.03 a)	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	8'800	0	0	8'800 CHF	94.65%	8'329'200.00	0.23 a)	
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	700	0	0	700 CHF	93.00%	651'000.00	0.02 a)	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	500	0	0	500 CHF	91.15%	455'750.00	0.01 a)	
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	10'400	0	500	9'900 CHF	94.95%	9'400'050.00	0.26 a)	
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	3'950	0	0	3'950 CHF	89.57%	3'538'015.00	0.10 a)	
CH0419040974	0.8500 % KBLUZE 0.85 03/12/42	1'700	0	0	1'700 CHF	87.35%	1'484'950.00	0.04 a)	
CH0419040982	0.5000 % SCMNVS 0 1/2 03/15/29	1'600	200	0	1'800 CHF	95.75%	1'723'500.00	0.05 a)	
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	2'800	0	0	2'800 CHF	98.70%	2'763'600.00	0.08 a)	
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	2'100	0	0	2'100 CHF	96.30%	2'022'300.00	0.06 a)	
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	1'340	0	370	970 CHF	96.10%	932'170.00	0.03 a)	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	900	350	200	1'050 CHF	97.45%	1'023'225.00	0.03 a)	
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	1'025	0	200	825 CHF	95.15%	784'987.50	0.02 a)	
CH0419041097	0.1250 % BCG 0 1/8 04/23/26	1'300	0	0	1'300 CHF	97.00%	1'261'000.00	0.03 a)	
CH0419041139	0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27	1'200	0	0	1'200 CHF	96.10%	1'153'200.00	0.03 a)	
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	3'400	0	0	3'400 CHF	93.55%	3'180'700.00	0.09 a)	
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	1'000	0	0	1'000 CHF	91.10%	911'000.00	0.02 a)	
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	2'050	0	0	2'050 CHF	98.15%	2'012'075.00	0.06 a)	
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	5'000	1'100	0	6'100 CHF	93.90%	5'727'900.00	0.16 a)	
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	3'200	0	0	3'200 CHF	90.98%	2'911'360.00	0.08 a)	
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	800	500	0	1'300 CHF	96.70%	1'257'100.00	0.03 a)	
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	1'300	0	330	970 CHF	89.15%	864'755.00	0.02 a)	
CH0419041220	0.5500 % PPSNSW 0.55 02/04/28	1'350	0	0	1'350 CHF	95.65%	1'291'275.00	0.04 a)	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	1'800	0	0	1'800 CHF	93.25%	1'678'500.00	0.05 a)	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	4'315	250	200	4'365 CHF	96.15%	4'196'947.50	0.11 a)	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	700	0	0	700 CHF	84.35%	590'450.00	0.02 a)	
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	2'100	500	0	2'600 CHF	91.15%	2'369'900.00	0.06 a)	
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	1'550	0	0	1'550 CHF	95.40%	1'478'700.00	0.04 a)	
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	800	300	0	1'100 CHF	95.00%	1'045'000.00	0.03 a)	
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	1'700	0	500	1'200 CHF	82.95%	995'400.00	0.03 a)	
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	2'400	0	0	2'400 CHF	85.15%	2'043'600.00	0.06 a)	
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	600	0	0	600 CHF	88.45%	530'700.00	0.01 a)	
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	1'400	0	600	800 CHF	92.20%	737'600.00	0.02 a)	
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	2'500	0	0	2'500 CHF	81.74%	2'043'500.00	0.06 a)	
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'200	0	0	1'200 CHF	76.30%	915'600.00	0.03 a)	
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	600	1'080	0	1'680 CHF	92.00%	1'545'600.00	0.04 a)	
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	1'100	0	0	1'100 CHF	63.15%	694'650.00	0.02 a)	
CH0419041527	0.0000 % LLBSW 0 09/27/29	1'000	0	0	1'000 CHF	90.35%	903'500.00	0.02 a)	
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	1'300	0	0	1'300 CHF	75.60%	982'800.00	0.03 a)	
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'940	600	1'640	2'900 CHF	77.90%	2'259'100.00	0.06 a)	
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.35%	923'500.00	0.03 a)	
CH0419041600	0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34	1'000	365	0	1'365 CHF	89.00%	1'214'850.00	0.03 a)	
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	900	0	0	900 CHF	91.55%	823'950.00	0.02 a)	
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'600	0	0	1'600 CHF	95.95%	1'535'200.00	0.04 a)	
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	1'650	500	500	1'650 CHF	97.40%	1'607'100.00	0.04 a)	
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	600	0	0	600 CHF	98.05%	588'300.00	0.02 a)	
CH0419042491	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24	7'900	0	7'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	5'000	0	0	5'000 CHF	97.60%	4'880'000.00	0.13 a)	
CH0422393121	0.8750 % EFIAGC 0 7/8 10/18/23	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	6'850	0	0	6'850 CHF	98.09%	6'719'165.00	0.18	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	8'130	320	700	7'750 CHF	96.06%	7'444'650.00	0.20	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	2'050	0	2'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	1'150	0	0	1'150 CHF	99.20%	1'140'800.00	0.03	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	9'200	320	500	9'020 CHF	95.98%	8'657'396.00	0.24	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	2'400	0	0	2'400 CHF	92.07%	2'209'680.00	0.06	a)
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	800	915	800	915 CHF	98.30%	899'445.00	0.02	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	3'850	0	3'100	750 CHF	99.41%	745'575.00	0.02	a)
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	4'200	0	0	4'200 CHF	98.25%	4'126'500.00	0.11	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	3'500	0	200	3'300 CHF	96.25%	3'176'250.00	0.09	a)
CH0434678352	1.1250 % BOBST 1 1/8 09/27/24	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.00%	980'000.00	0.03	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	4'325	315	0	4'640 CHF	96.86%	4'494'304.00	0.12	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	750	2'200	0	2'950 CHF	94.27%	2'780'965.00	0.08	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'365	0	2'365	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	1'000	0	200	800 CHF	96.70%	773'600.00	0.02	a)
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	3'100	0	1'000	2'100 CHF	98.65%	2'071'650.00	0.06	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNWX 0 3/4 10/12/28	1'200	150	0	1'350 CHF	97.25%	1'312'875.00	0.04	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	4'310	2'800	0	7'110 CHF	94.03%	6'685'533.00	0.18	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	17'950	12'000	3'400	26'550 CHF	91.96%	24'415'380.00	0.67	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	23'975	8'624	3'900	28'699 CHF	88.00%	25'255'120.00	0.69	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	8'400	11'100	1'600	17'900 CHF	109.40%	19'582'600.00	0.54	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	600	0	0	600 CHF	93.90%	563'400.00	0.02	a)
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	6'600	400	1'345	5'655 CHF	97.04%	5'487'612.00	0.15	a)
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	1'100	750	0	1'850 CHF	97.50%	1'803'750.00	0.05	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	1'500	0	0	1'500 CHF	96.70%	1'450'500.00	0.04	a)
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'700	610	600	1'710 CHF	97.35%	1'664'685.00	0.05	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	600	0	0	600 CHF	96.20%	577'200.00	0.02	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	200	800 CHF	94.90%	759'200.00	0.02	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	1'800	3'400	0	5'200 CHF	97.15%	5'051'800.00	0.14	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	600	0	0	600 CHF	93.05%	558'300.00	0.02	a)
CH0457206800	0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	2'000	0	550	1'450 CHF	97.60%	1'415'200.00	0.04	a)
CH0457723549	0.3500 % SGKNSW 0.35 01/24/28	2'200	0	0	2'200 CHF	96.00%	2'112'000.00	0.06	a)
CH0458097976	0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25	1'800	0	0	1'800 CHF	98.20%	1'767'600.00	0.05	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	3'600	0	3'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	1'000	400	0	1'400 CHF	97.45%	1'364'300.00	0.04	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	1'200	0	0	1'200 CHF	94.65%	1'135'800.00	0.03	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	3'800	1'500	500	4'800 CHF	89.96%	4'318'080.00	0.12	a)
CH0461238864	0.3750 % SRAIL 0 3/8 11/20/26	2'600	0	0	2'600 CHF	96.40%	2'506'400.00	0.07	a)
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	1'600	0	0	1'600 CHF	92.55%	1'480'800.00	0.04	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	1'700	400	0	2'100 CHF	85.15%	1'788'150.00	0.05	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN	1'100	1'000	0	2'100 CHF	98.10%	2'060'100.00	0.06	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN	1'700	0	400	1'300 CHF	93.85%	1'220'050.00	0.03	a)
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	2'120	0	200	1'920 CHF	95.25%	1'828'800.00	0.05	a)
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	9'300	0	1'200	8'100 CHF	90.55%	7'334'550.00	0.20	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	3'370	0	700	2'670 CHF	84.65%	2'260'155.00	0.06	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'000	500	0	1'500 CHF	86.65%	1'299'750.00	0.04	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	2'950	500	800	2'650 CHF	90.60%	2'400'900.00	0.07	a)
CH0461239060	0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29	900	600	0	1'500 CHF	92.70%	1'390'500.00	0.04	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	3'400	0	0	3'400 CHF	90.60%	3'080'400.00	0.08	a)
CH0461239102	0.0000 % SWISSG 0 06/30/28	1'000	0	0	1'000 CHF	94.00%	940'000.00	0.03	a)
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	1'500	0	0	1'500 CHF	89.30%	1'339'500.00	0.04	a)
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	6'520	0	500	6'020 CHF	90.35%	5'439'070.00	0.15	a)
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	800	800	300	1'300 CHF	95.05%	1'235'650.00	0.03	a)
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	2'795	0	0	2'795 CHF	91.29%	2'551'555.50	0.07	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	1'580	585	730	1'435 CHF	97.45%	1'398'407.50	0.04	a)
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'500	0	0	1'500 CHF	93.60%	1'404'000.00	0.04	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	700	500	0	1'200 CHF	98.55%	1'182'600.00	0.03	a)
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	6'400	250	0	6'650 CHF	93.59%	6'223'735.00	0.17	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	1'550	0	0	1'550 CHF	98.36%	1'524'580.00	0.04	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474178420	0.1250 % RAIFFS 0 1/8 05/07/24	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	7'550	0	1'400	6'150 CHF	93.98%	5'779'770.00	0.16	a)
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	1'500	0	0	1'500 CHF	93.60%	1'404'000.00	0.04	a)
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	1'135	0	0	1'135 CHF	98.09%	1'113'321.50	0.03	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	2'000	0	0	2'000 CHF	91.90%	1'838'000.00	0.05	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	4'370	1'000	1'600	3'770 CHF	92.02%	3'469'154.00	0.09	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	3'000	1'500	0	4'500 CHF	84.88%	3'819'600.00	0.10	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.60%	926'000.00	0.03	a)
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	1'500	0	0	1'500 CHF	91.90%	1'378'500.00	0.04	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	1'410	400	0	1'810 CHF	92.00%	1'665'200.00	0.05	a)
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	1'600	0	200	1'400 CHF	94.00%	1'316'000.00	0.04	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	3'300	0	500	2'800 CHF	85.25%	2'387'000.00	0.07	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	5'600	0	0	5'600 CHF	95.76%	5'362'560.00	0.15	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	6'450	3'300	2'800	6'950 CHF	88.90%	6'178'550.00	0.17	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'500	0	0	1'500 CHF	83.49%	1'252'350.00	0.03	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	7'065	1'100	0	8'165 CHF	69.65%	5'686'922.50	0.16	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	900	0	0	900 CHF	92.00%	828'000.00	0.02	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	1'650	0	0	1'650 CHF	74.00%	1'221'000.00	0.03	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	0	2'250	0	2'250 CHF	95.55%	2'149'875.00	0.06	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	2'100	0	500	1'600 CHF	94.75%	1'516'000.00	0.04	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	1'200	0	0	1'200 CHF	86.30%	1'035'600.00	0.03	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	1'820	310	0	2'130 CHF	95.70%	2'038'410.00	0.06	a)
CH0488506665	0.0000 % PSPNSW 0 02/06/30	1'200	0	0	1'200 CHF	90.50%	1'086'000.00	0.03	a)
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	1'900	0	0	1'900 CHF	89.60%	1'702'400.00	0.05	a)
CH0494734335	0.0000 % SCMNXX 0 08/30/44	1'500	0	445	1'055 CHF	70.95%	748'522.50	0.02	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'750	0	0	1'750 CHF	63.20%	1'106'000.00	0.03	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	900	0	0	900 CHF	65.05%	585'450.00	0.02	a)
CH0494734426	0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25	460	0	0	460 CHF	97.15%	446'890.00	0.01	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	900	400	400	900 CHF	96.20%	865'800.00	0.02	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	900	0	0	900 CHF	91.20%	820'800.00	0.02	a)
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	1'200	0	0	1'200 CHF	71.10%	853'200.00	0.02	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	4'900	0	0	4'900 CHF	97.25%	4'765'250.00	0.13	a)
CH0502393405	0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25	2'000	0	0	2'000 CHF	97.90%	1'958'000.00	0.05	a)
CH0505011871	0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	91.60%	1'282'400.00	0.04	a)
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'120	300	0	1'420 CHF	94.65%	1'344'030.00	0.04	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	1'900	0	0	1'900 CHF	90.80%	1'725'200.00	0.05	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	2'800	0	1'500	1'300 CHF	83.90%	1'090'700.00	0.03	a)
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	2'100	0	0	2'100 CHF	91.60%	1'923'600.00	0.05	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	2'030	0	0	2'030 CHF	91.45%	1'856'435.00	0.05	a)
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	2'500	0	0	2'500 CHF	93.90%	2'347'500.00	0.06	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	8'080	0	1'500	6'580 CHF	90.77%	5'972'666.00	0.16	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'700	0	0	2'700 CHF	79.33%	2'141'910.00	0.06	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	560	0	0	560 CHF	93.70%	524'720.00	0.01	a)
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	2'000	500	0	2'500 CHF	94.10%	2'352'500.00	0.06	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	2'300	0	500	1'800 CHF	91.60%	1'648'800.00	0.05	a)
CH0506071262	0.3000 % KBBERN 0.3 05/29/30	1'000	0	0	1'000 CHF	92.75%	927'500.00	0.03	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	1'500	500	500	1'500 CHF	91.75%	1'376'250.00	0.04	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	720	0	0	720 CHF	94.05%	677'160.00	0.02	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	1'500	0	400	1'100 CHF	92.60%	1'018'600.00	0.03	a)
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	3'000	165	0	3'165 CHF	88.70%	2'807'355.00	0.08	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	2'100	0	0	2'100 CHF	89.80%	1'885'800.00	0.05	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	1'100	0	0	1'100 CHF	89.90%	988'900.00	0.03	a)
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	2'300	0	0	2'300 CHF	96.85%	2'227'550.00	0.06	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	1'500	0	0	1'500 CHF	85.70%	1'285'500.00	0.04	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	3'835	0	0	3'835 CHF	90.80%	3'482'180.00	0.10	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	1'090	0	0	1'090 CHF	85.00%	926'500.00	0.03	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	1'000	700	0	1'700 CHF	92.70%	1'575'900.00	0.04	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	3'100	0	0	3'100 CHF	96.00%	2'976'000.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0515152467	0.1300 % SCMNFX 0.13 09/18/31	700	0	0	700 CHF	90.40%	632'800.00	0.02	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	900	0	0	900 CHF	87.90%	791'100.00	0.02	a)
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	2'400	0	1'400	1'000 CHF	91.90%	919'000.00	0.03	a)
CH0519465170	0.1250 % AMALEA 0 1/8 02/12/24	620	0	620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520042513	0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26	1'400	0	0	1'400 CHF	97.40%	1'363'600.00	0.04	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	97.59%	3'122'880.00	0.09	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	2'870	0	0	2'870 CHF	89.70%	2'574'390.00	0.07	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	1'050	0	200	850 CHF	87.55%	744'175.00	0.02	a)
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	3'150	400	335	3'215 CHF	85.70%	2'755'255.00	0.08	a)
CH0521617297	0.0000 % WKBNSW 0 02/14/29	2'000	485	985	1'500 CHF	93.05%	1'395'750.00	0.04	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	3'000	1'500	1'100	3'400 CHF	84.45%	2'871'300.00	0.08	a)
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	2'700	0	0	2'700 CHF	86.65%	2'339'550.00	0.06	a)
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	1'305	0	0	1'305 CHF	85.50%	1'115'775.00	0.03	a)
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	2'100	0	475	1'625 CHF	88.80%	1'443'000.00	0.04	a)
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	1'535	0	800	735 CHF	91.25%	670'687.50	0.02	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	2'100	0	300	1'800 CHF	89.55%	1'611'900.00	0.04	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	900	0	0	900 CHF	91.15%	820'350.00	0.02	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	1'400	0	300	1'100 CHF	86.45%	950'950.00	0.03	a)
CH0522158960	0.3126 % KBFRIE 0.3126 02/02/32	2'180	0	500	1'680 CHF	90.50%	1'520'400.00	0.04	a)
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	3'300	0	800	2'500 CHF	91.75%	2'293'750.00	0.06	a)
CH0522158986	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 01/24/30	1'900	150	0	2'050 CHF	93.20%	1'910'600.00	0.05	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	1'700	100	0	1'800 CHF	96.65%	1'739'700.00	0.05	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	1'400	0	0	1'400 CHF	100.75%	1'410'500.00	0.04	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	2'000	0	0	2'000 CHF	102.30%	2'046'000.00	0.06	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	1'800	0	0	1'800 CHF	100.75%	1'813'500.00	0.05	a)
CH0522159091	1.4000 % SGKNSW 1.4 06/21/30	2'200	0	0	2'200 CHF	99.65%	2'192'300.00	0.06	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	88.30%	1'854'300.00	0.05	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	6'540	0	0	6'540 CHF	94.84%	6'202'536.00	0.17	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	2'900	0	0	2'900 CHF	73.18%	2'122'220.00	0.06	a)
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	1'770	0	700	1'070 CHF	97.05%	1'038'435.00	0.03	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	4'000	60	0	4'060 CHF	92.31%	3'747'786.00	0.10	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	600	2'090	0	2'690 CHF	96.00%	2'582'400.00	0.07	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	2'000	850	0	2'850 CHF	98.35%	2'802'975.00	0.08	a)
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	6'400	0	0	6'400 CHF	90.22%	5'774'080.00	0.16	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	2'050	1'500	1'025	2'525 CHF	79.75%	2'013'687.50	0.06	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	3'785	1'450	2'000	3'235 CHF	95.10%	3'076'485.00	0.08	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	2'245	1'000	0	3'245 CHF	77.70%	2'521'365.00	0.07	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	3'700	0	0	3'700 CHF	92.51%	3'422'870.00	0.09	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	1'860	0	0	1'860 CHF	82.23%	1'529'478.00	0.04	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	1'800	100	500	1'400 CHF	97.75%	1'368'500.00	0.04	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	3'880	1'500	0	5'380 CHF	86.95%	4'677'910.00	0.13	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	5'900	250	1'200	4'950 CHF	94.47%	4'676'265.00	0.13	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	5'595	600	2'200	3'995 CHF	86.05%	3'437'697.50	0.09	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	1'980	0	0	1'980 CHF	95.60%	1'892'880.00	0.05	a)
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'600	0	300	1'300 CHF	90.35%	1'174'550.00	0.03	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	2'200	530	1'035	1'695 CHF	95.25%	1'614'487.50	0.04	a)
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	1'360	0	0	1'360 CHF	85.40%	1'161'440.00	0.03	a)
CH0536893362	0.1500 % WKBNSW 0.15 10/05/32	1'350	0	0	1'350 CHF	88.55%	1'195'425.00	0.03	a)
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	6'370	0	1'000	5'370 CHF	91.80%	4'929'660.00	0.13	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	1'300	0	0	1'300 CHF	75.96%	987'480.00	0.03	a)
CH0536893461	0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0	900	0	0	900 CHF	89.75%	807'750.00	0.02	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	1'400	400	0	1'800 CHF	83.95%	1'511'100.00	0.04	a)
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	1'800	2'520	0	4'320 CHF	95.98%	4'146'336.00	0.11	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	1'800	0	0	1'800 CHF	85.72%	1'542'960.00	0.04	a)
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	1'000	0	0	1'000 CHF	96.35%	963'500.00	0.03	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	3'000	2'325	0	5'325 CHF	95.03%	5'060'347.50	0.14	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	2'200	0	0	2'200 CHF	98.65%	2'170'300.00	0.06	a)
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	2'100	0	0	2'100 CHF	98.80%	2'074'800.00	0.06	a)
CH0545766609	0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25	1'300	0	0	1'300 CHF	98.04%	1'274'520.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	1'300	800	0	2'100 CHF	93.50%	1'963'500.00	0.05	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	2'500	0	0	2'500 CHF	82.60%	2'065'000.00	0.06	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	2'100	0	0	2'100 CHF	98.35%	2'065'350.00	0.06	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	2'600	470	360	2'710 CHF	96.70%	2'620'570.00	0.07	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	94.20%	3'297'000.00	0.09	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	900	0	0	900 CHF	91.45%	823'050.00	0.02	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	700	0	0	700 CHF	79.85%	558'950.00	0.02	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	4'650	0	0	4'650 CHF	80.02%	3'720'930.00	0.10	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'500	0	0	1'500 CHF	98.35%	1'475'250.00	0.04	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	1'200	0	0	1'200 CHF	76.00%	912'000.00	0.02	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	1'900	500	0	2'400 CHF	98.90%	2'373'600.00	0.06	a)
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	1'750	400	500	1'650 CHF	96.30%	1'588'950.00	0.04	a)
CH0553331825	0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30	1'300	0	230	1'070 CHF	92.10%	985'470.00	0.03	a)
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	600	0	0	600 CHF	72.35%	434'100.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	5'265	0	0	5'265 CHF	92.50%	4'870'125.00	0.13	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	4'350	0	0	4'350 CHF	81.65%	3'551'775.00	0.10	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	1'130	0	200	930 CHF	95.90%	891'870.00	0.02	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	15'770	7'900	4'300	19'370 CHF	94.18%	18'242'666.00	0.50	a)
CH0557778799	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 MAY	0	6'400	6'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778807	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 MAY	0	6'900	6'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	16'200	0	16'200 CHF	108.04%	17'502'480.00	0.48	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	5'100	5'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778849	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 SEP	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778856	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 SEP	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778864	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 OCT	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778880	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 OCT	0	3'200	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	4'600	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	4'600	4'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778948	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 FEB	0	3'100	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	2'100	0	0	2'100 CHF	98.15%	2'061'150.00	0.06	a)
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	2'000	0	0	2'000 CHF	64.15%	1'283'000.00	0.04	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	4'485	0	0	4'485 CHF	80.19%	3'596'521.50	0.10	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	1'960	0	500	1'460 CHF	91.35%	1'333'710.00	0.04	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	980	500	300	1'180 CHF	96.70%	1'141'060.00	0.03	a)
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	2'000	1'250	1'500	1'750 CHF	93.85%	1'642'375.00	0.04	a)
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	2'500	0	395	2'105 CHF	90.60%	1'907'130.00	0.05	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	1'975	0	0	1'975 CHF	80.10%	1'581'975.00	0.04	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	2'100	0	500	1'600 CHF	90.30%	1'444'800.00	0.04	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	590	0	0	590 CHF	76.85%	453'415.00	0.01	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	2'700	0	0	2'700 CHF	92.70%	2'502'900.00	0.07	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	2'205	0	500	1'705 CHF	87.40%	1'490'170.00	0.04	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	1'700	0	0	1'700 CHF	89.95%	1'529'150.00	0.04	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	1'100	0	0	1'100 CHF	96.10%	1'057'100.00	0.03	a)
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'260	0	0	1'260 CHF	88.00%	1'108'800.00	0.03	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	10'030	2'000	3'950	8'080 CHF	92.25%	7'453'800.00	0.20	a)
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	900	0	0	900 CHF	84.85%	763'650.00	0.02	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	900	0	0	900 CHF	78.05%	702'450.00	0.02	a)
CH0570576568	0.1000 % FHZNSW 0.1 12/30/27	1'900	0	0	1'900 CHF	94.75%	1'800'250.00	0.05	a)
CH0572142484	0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN	2'100	0	0	2'100 CHF	90.80%	1'906'800.00	0.05	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	2'100	2'100	1'000	3'200 CHF	98.01%	3'136'320.00	0.09	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	2'400	0	0	2'400 CHF	88.22%	2'117'280.00	0.06	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	850	0	0	850 CHF	93.75%	796'875.00	0.02	a)
CH0572899091	0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'800	0	0	1'800 CHF	93.60%	1'684'800.00	0.05	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	6'000	785	0	6'785 CHF	92.77%	6'294'444.50	0.17	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	6'600	0	0	6'600 CHF	89.46%	5'904'360.00	0.16	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	1'000	0	0	1'000 CHF	65.60%	656'000.00	0.02	a)
CH0576402165	0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27	2'025	0	320	1'705 CHF	96.30%	1'641'915.00	0.04	a)
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	1'035	0	200	835 CHF	90.60%	756'510.00	0.02	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	1'600	120	400	1'320 CHF	53.95%	712'140.00	0.02	a)
CH0580291968	0.2450 % SCMNVX 0.245 11/20/34	0	1'000	0	1'000 CHF	87.55%	875'500.00	0.02	a)
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	900	0	0	900 CHF	92.60%	833'400.00	0.02	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	2'830	0	0	2'830 CHF	93.75%	2'653'125.00	0.07	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	3'025	0	400	2'625 CHF	94.85%	2'489'812.50	0.07	a)
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	4'350	0	1'000	3'350 CHF	87.30%	2'924'550.00	0.08	a)
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'400	0	500	900 CHF	98.40%	885'600.00	0.02	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	7'400	0	500	6'900 CHF	93.69%	6'464'610.00	0.18	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	5'200	0	800	4'400 CHF	87.95%	3'869'800.00	0.11	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	6'525	600	0	7'125 CHF	84.05%	5'988'562.50	0.16	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	4'600	0	0	4'600 CHF	90.77%	4'175'420.00	0.11	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	1'020	0	0	1'020 CHF	86.60%	883'320.00	0.02	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	1'600	0	1'000	600 CHF	95.75%	574'500.00	0.02	a)
CH0591084253	0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31	2'300	0	0	2'300 CHF	90.85%	2'089'550.00	0.06	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	4'100	0	700	3'400 CHF	77.41%	2'631'940.00	0.07	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	95.30%	857'700.00	0.02	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	86.00%	1'118'000.00	0.03	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	1'150	0	0	1'150 CHF	87.35%	1'004'525.00	0.03	a)
CH0593093211	0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31	900	0	0	900 CHF	89.50%	805'500.00	0.02	a)
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	2'445	300	600	2'145 CHF	89.55%	1'920'847.50	0.05	a)
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	2'800	0	0	2'800 CHF	89.08%	2'494'240.00	0.07	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	1'000	0	0	1'000 CHF	81.43%	814'300.00	0.02	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	850	700	0	1'550 CHF	94.05%	1'457'775.00	0.04	a)
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	2'400	1'000	0	3'400 CHF	92.10%	3'131'400.00	0.09	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	6'470	3'200	1'500	8'170 CHF	91.67%	7'489'439.00	0.20	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	1'800	0	0	1'800 CHF	89.10%	1'603'800.00	0.04	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	1'680	400	0	2'080 CHF	97.25%	2'022'800.00	0.06	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	2'800	0	200	2'600 CHF	90.70%	2'358'200.00	0.06	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	2'000	400	600	1'800 CHF	85.85%	1'545'300.00	0.04	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	10'040	0	1'000	9'040 CHF	94.82%	8'571'728.00	0.23	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	2'400	0	1'200	1'200 CHF	89.91%	1'078'920.00	0.03	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	3'500	500	0	4'000 CHF	86.95%	3'478'000.00	0.10	a)
CH1101096555	0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28	2'160	150	0	2'310 CHF	93.35%	2'156'385.00	0.06	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	800	0	0	800 CHF	95.30%	762'400.00	0.02	a)
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	4'000	0	200	3'800 CHF	88.60%	3'366'800.00	0.09	a)
CH1101096647	0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31	3'100	0	500	2'600 CHF	90.35%	2'349'100.00	0.06	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	2'040	500	0	2'540 CHF	96.00%	2'438'400.00	0.07	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	1'200	0	0	1'200 CHF	92.15%	1'105'800.00	0.03	a)
CH1105672674	0.5000 % SWICA 2021-1 A	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	1'200	0	0	1'200 CHF	93.80%	1'125'600.00	0.03	a)
CH1105672708	0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26	560	280	0	840 CHF	96.60%	811'440.00	0.02	a)
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	8'175	0	0	8'175 CHF	91.33%	7'466'227.50	0.20	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	3'125	0	0	3'125 CHF	86.82%	2'713'125.00	0.07	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	3'900	0	1'000	2'900 CHF	82.38%	2'389'020.00	0.07	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	1'800	0	400	1'400 CHF	88.65%	1'241'100.00	0.03	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSW 0.1 04/18/31	3'300	400	1'280	2'420 CHF	90.50%	2'190'100.00	0.06	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	1'400	0	0	1'400 CHF	93.55%	1'309'700.00	0.04	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	1'000	0	0	1'000 CHF	96.15%	961'500.00	0.03	a)
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	2'200	0	0	2'200 CHF	91.95%	2'022'900.00	0.06	a)
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	1'725	635	1'000	1'360 CHF	94.00%	1'278'400.00	0.03	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	3'610	150	195	3'565 CHF	91.05%	3'245'932.50	0.09	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	1'000	0	0	1'000 CHF	89.10%	891'000.00	0.02	a)
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'400	0	295	2'105 CHF	97.00%	2'041'850.00	0.06	a)
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	1'730	0	200	1'530 CHF	92.70%	1'418'310.00	0.04	a)
CH1112940601	0.0500 % NIDKKB 0.05 05/27/31	1'835	0	450	1'385 CHF	89.45%	1'238'882.50	0.03	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	2'200	0	0	2'200 CHF	89.00%	1'958'000.00	0.05	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	1'605	0	0	1'605 CHF	90.15%	1'446'907.50	0.04	a)
CH1115424678	0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26	1'500	0	0	1'500 CHF	96.75%	1'451'250.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1118223366	0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30	1'900	345	0	2'245 CHF	91.80%	2'060'910.00	0.06	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNBK 1 07/28/31	1'230	0	0	1'230 CHF	93.90%	1'154'970.00	0.03	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	740	280	0	1'020 CHF	91.55%	933'810.00	0.03	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	4'300	0	0	4'300 CHF	89.80%	3'861'400.00	0.11	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	1'605	0	500	1'105 CHF	88.90%	982'345.00	0.03	a)
CH1118223499	0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36	1'710	0	0	1'710 CHF	83.65%	1'430'415.00	0.04	a)
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	1'700	0	0	1'700 CHF	82.30%	1'399'100.00	0.04	a)
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	88.70%	1'330'500.00	0.04	a)
CH1118483663	0.3500 % SWICC 2021-1 A	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	1'750	0	0	1'750 CHF	98.53%	1'724'275.00	0.05	a)
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	2'200	200	800	1'600 CHF	89.00%	1'424'000.00	0.04	a)
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	2'335	500	700	2'135 CHF	95.22%	2'032'947.00	0.06	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	3'000	0	0	3'000 CHF	80.47%	2'414'100.00	0.07	a)
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'400	0	0	2'400 CHF	78.30%	1'879'200.00	0.05	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	1'100	0	0	1'100 CHF	95.40%	1'049'400.00	0.03	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	1'100	500	0	1'600 CHF	91.20%	1'459'200.00	0.04	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	1'000	0	0	1'000 CHF	91.40%	914'000.00	0.03	a)
CH1129053794	0.1250 % WKBNWSW 0 1/8 09/15/33	2'115	0	0	2'115 CHF	86.80%	1'835'820.00	0.05	a)
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	700	0	0	700 CHF	86.20%	603'400.00	0.02	a)
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	1'600	0	755	845 CHF	77.40%	654'030.00	0.02	a)
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	900	0	0	900 CHF	84.45%	760'050.00	0.02	a)
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	950	0	0	950 CHF	97.90%	930'050.00	0.03	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'675	0	0	1'675 CHF	90.60%	1'517'550.00	0.04	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	6'275	750	0	7'025 CHF	90.33%	6'345'682.50	0.17	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'800	500	1'590	1'710 CHF	83.20%	1'422'720.00	0.04	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	360	0	0	360 CHF	97.60%	351'360.00	0.01	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'710	0	655	1'055 CHF	83.60%	881'980.00	0.02	a)
CH1131931292	0.0000 % SWISSG 0 06/30/26	1'575	0	0	1'575 CHF	96.65%	1'522'237.50	0.04	a)
CH1131931300	0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31	845	60	0	905 CHF	89.60%	810'880.00	0.02	a)
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	910	0	200	710 CHF	87.40%	620'540.00	0.02	a)
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	700	0	0	700 CHF	91.45%	640'150.00	0.02	a)
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'500	0	0	1'500 CHF	90.80%	1'362'000.00	0.04	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	2'200	0	1'200	1'000 CHF	86.46%	864'600.00	0.02	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	2'285	0	1'000	1'285 CHF	87.50%	1'124'375.00	0.03	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	4'675	0	1'000	3'675 CHF	91.11%	3'348'292.50	0.09	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	2'700	0	0	2'700 CHF	86.61%	2'338'470.00	0.06	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	2'350	1'500	0	3'850 CHF	92.50%	3'561'250.00	0.10	a)
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	1'610	0	100	1'510 CHF	92.40%	1'395'240.00	0.04	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'980	200	0	2'180 CHF	97.65%	2'128'770.00	0.06	a)
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	1'400	0	545	855 CHF	92.80%	793'440.00	0.02	a)
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	1'500	500	0	2'000 CHF	90.15%	1'803'000.00	0.05	a)
CH1139995778	0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	1'000	0	0	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.03	a)
CH1141700414	0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28	1'520	250	0	1'770 CHF	94.15%	1'666'455.00	0.05	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	1'800	0	500	1'300 CHF	74.85%	973'050.00	0.03	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	2'300	370	960	1'710 CHF	86.40%	1'477'440.00	0.04	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	2'625	0	435	2'190 CHF	98.30%	2'152'770.00	0.06	a)
CH1141700539	0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29	900	0	0	900 CHF	92.50%	832'500.00	0.02	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	3'500	0	600	2'900 CHF	95.95%	2'782'550.00	0.08	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	1'000	0	0	1'000 CHF	73.25%	732'500.00	0.02	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	2'650	1'000	0	3'650 CHF	91.33%	3'333'545.00	0.09	a)
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	200	1'700	0	1'900 CHF	96.50%	1'833'500.00	0.05	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	3'800	200	0	4'000 CHF	93.90%	3'756'000.00	0.10	a)
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	900	0	0	900 CHF	91.50%	823'500.00	0.02	a)
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	1'045	0	0	1'045 CHF	94.51%	987'629.50	0.03	a)
CH1148266195	0.6250 % SYNNSW 0 5/8 08/30/24	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266245	0.3000 % WKBNWSW 0.3 02/07/30	1'200	0	0	1'200 CHF	92.95%	1'115'400.00	0.03	a)
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'400	0	200	1'200 CHF	92.60%	1'111'200.00	0.03	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	1'400	1'200	900	1'700 CHF	95.65%	1'626'050.00	0.04	a)
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	990	0	0	990 CHF	92.95%	920'205.00	0.03	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	1'075	4'200	0	5'275 CHF	91.33%	4'817'657.50	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	3'000	250	0	3'250 CHF	92.25%	2'998'125.00	0.08	a)
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	2'000	0	500	1'500 CHF	90.50%	1'357'500.00	0.04	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	2'800	0	1'100	1'700 CHF	91.57%	1'556'690.00	0.04	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	2'000	0	500	1'500 CHF	83.86%	1'257'900.00	0.03	a)
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	900	150	0	1'050 CHF	94.40%	991'200.00	0.03	a)
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	1'700	0	0	1'700 CHF	96.25%	1'636'250.00	0.04	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	3'050	950	0	4'000 CHF	96.76%	3'870'400.00	0.11	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	4'700	0	800	3'900 CHF	94.67%	3'692'130.00	0.10	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	1'400	0	0	1'400 CHF	91.44%	1'280'160.00	0.04	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	1'550	0	0	1'550 CHF	90.20%	1'398'100.00	0.04	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	7'850	0	0	7'850 CHF	90.67%	7'117'595.00	0.19	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	1'545	0	0	1'545 CHF	94.24%	1'456'008.00	0.04	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	500	2'000	0	2'500 CHF	87.18%	2'179'500.00	0.06	a)
CH1154887132	0.3750 % HOLNSW 0 3/8 10/19/26	3'000	500	230	3'270 CHF	96.75%	3'163'725.00	0.09	a)
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	1'500	200	700	1'000 CHF	94.25%	942'500.00	0.03	a)
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	900	0	0	900 CHF	93.45%	841'050.00	0.02	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	1'600	0	0	1'600 CHF	98.62%	1'577'920.00	0.04	a)
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	3'440	0	1'500	1'940 CHF	97.00%	1'881'800.00	0.05	a)
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	800	250	0	1'050 CHF	93.80%	984'900.00	0.03	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	0	1'800	0	1'800 CHF	97.07%	1'747'260.00	0.05	a)
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	1'700	0	0	1'700 CHF	92.60%	1'574'200.00	0.04	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	1'600	0	0	1'600 CHF	95.30%	1'524'800.00	0.04	a)
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	1'200	0	0	1'200 CHF	94.75%	1'137'000.00	0.03	a)
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	7'100	1'870	1'350	7'620 CHF	97.80%	7'452'360.00	0.20	a)
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	5'700	0	550	5'150 CHF	95.85%	4'936'275.00	0.14	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	3'700	1'900	3'040	2'560 CHF	94.15%	2'410'240.00	0.07	a)
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	0	1'300	0	1'300 CHF	96.82%	1'258'660.00	0.03	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	1'800	0	0	1'800 CHF	92.57%	1'666'260.00	0.05	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	1'050	0	0	1'050 CHF	79.45%	834'225.00	0.02	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	3'300	500	0	3'800 CHF	97.85%	3'718'300.00	0.10	a)
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	800	0	0	800 CHF	97.70%	781'600.00	0.02	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	1'000	400	0	1'400 CHF	95.40%	1'335'600.00	0.04	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	0	3'740	0	3'740 CHF	96.29%	3'601'246.00	0.10	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	2'100	0	0	2'100 CHF	95.51%	2'005'710.00	0.05	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	1'500	900	1'100	1'300 CHF	94.07%	1'222'910.00	0.03	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	2'900	0	1'000	1'900 CHF	98.55%	1'872'450.00	0.05	a)
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	3'800	400	500	3'700 CHF	97.85%	3'620'450.00	0.10	a)
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	1'200	0	345	855 CHF	97.30%	831'915.00	0.02	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	1'060	0	0	1'060 CHF	99.55%	1'055'230.00	0.03	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	2'895	465	700	2'660 CHF	98.55%	2'621'430.00	0.07	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	4'505	0	1'000	3'505 CHF	99.05%	3'471'702.50	0.10	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	6'200	1'550	0	7'750 CHF	99.85%	7'738'375.00	0.21	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	4'300	0	0	4'300 CHF	99.55%	4'280'650.00	0.12	a)
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'300	0	0	1'300 CHF	99.35%	1'291'550.00	0.04	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	5'500	250	1'250	4'500 CHF	97.81%	4'401'450.00	0.12	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	900	1'000	0	1'900 CHF	93.29%	1'772'510.00	0.05	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	1'700	450	0	2'150 CHF	99.60%	2'141'400.00	0.06	a)
CH117791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	1'600	0	0	1'600 CHF	96.55%	1'544'800.00	0.04	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	1'700	0	0	1'700 CHF	98.60%	1'676'200.00	0.05	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	925	0	0	925 CHF	97.60%	902'800.00	0.02	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	550	0	0	550 CHF	97.85%	538'175.00	0.01	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	2'100	500	200	2'400 CHF	98.75%	2'370'000.00	0.06	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	2'000	200	500	1'700 CHF	100.00%	1'700'000.00	0.05	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	5'150	3'400	0	8'550 CHF	99.80%	8'532'900.00	0.23	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	4'700	2'300	3'565	3'435 CHF	101.86%	3'498'891.00	0.10	a)
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	1'700	0	500	1'200 CHF	97.85%	1'174'200.00	0.03	a)
CH1184694755	1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25	1'600	150	0	1'750 CHF	99.71%	1'744'925.00	0.05	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	1'800	0	520	1'280 CHF	99.05%	1'267'840.00	0.03	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	1'800	0	0	1'800 CHF	99.85%	1'797'300.00	0.05	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	2'500	0	0	2'500 CHF	99.05%	2'476'250.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	2'600	150	500	2'250 CHF	99.22%	2'232'450.00	0.06	a)
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	2'050	55	800	1'305 CHF	99.45%	1'297'822.50	0.04	a)
CH1189217768	1.7000 % KTSPL 1.7 06/24/32	1'900	0	0	900 CHF	100.10%	900'900.00	0.02	a)
CH1189217784	1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27	1'900	800	1'025	1'675 CHF	98.80%	1'654'900.00	0.05	a)
CH1189217818	1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29	1'400	0	330	1'070 CHF	99.40%	1'063'580.00	0.03	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	3'800	1'800	0	5'600 CHF	100.82%	5'645'920.00	0.15	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	6'600	0	0	6'600 CHF	102.24%	6'747'840.00	0.18	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	2'900	500	1'000	2'400 CHF	106.76%	2'562'240.00	0.07	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	1'500	500	1'000	1'000 CHF	113.70%	1'137'000.00	0.03	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	2'400	150	400	2'150 CHF	101.50%	2'182'250.00	0.06	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	2'700	600	600	2'700 CHF	100.58%	2'715'660.00	0.07	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	3'300	6'250	0	9'550 CHF	101.95%	9'736'225.00	0.27	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	3'000	800	0	3'800 CHF	103.80%	3'944'400.00	0.11	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	1'800	500	0	2'300 CHF	99.95%	2'298'850.00	0.06	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	1'350	0	0	1'350 CHF	99.50%	1'343'250.00	0.04	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	2'890	0	0	2'890 CHF	100.35%	2'900'115.00	0.08	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	5'100	700	1'600	4'200 CHF	100.50%	4'221'000.00	0.12	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	1'500	200	0	1'700 CHF	98.25%	1'670'250.00	0.05	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'600	0	465	2'135 CHF	104.05%	2'221'467.50	0.06	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	1'900	500	600	1'800 CHF	100.25%	1'804'500.00	0.05	a)
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	770	500	0	1'270 CHF	99.05%	1'257'935.00	0.03	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	2'000	0	500	1'500 CHF	100.35%	1'505'250.00	0.04	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	415	0	0	415 CHF	101.35%	420'602.50	0.01	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	1'600	800	500	1'900 CHF	101.85%	1'935'150.00	0.05	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	2'400	0	0	2'400 CHF	100.90%	2'421'600.00	0.07	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'400	0	290	1'110 CHF	100.05%	1'110'555.00	0.03	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	2'200	495	1'705 CHF	100.22%	1'708'751.00	0.05	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	1'750	0	1'750 CHF	105.35%	1'843'625.00	0.05	a)
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	1'350	0	0	1'350 CHF	99.65%	1'345'275.00	0.04	a)
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	1'800	200	0	2'000 CHF	101.40%	2'028'000.00	0.06	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	3'900	2'000	1'400	4'500 CHF	105.72%	4'757'400.00	0.13	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	6'200	2'750	2'300	6'650 CHF	110.73%	7'363'545.00	0.20	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	1'400	3'950	1'300	4'050 CHF	119.87%	4'854'735.00	0.13	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	2'300	0	500	1'800 CHF	100.55%	1'809'900.00	0.05	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	6'000	0	0	6'000 CHF	100.65%	6'039'000.00	0.17	a)
CH1194355116	2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30	4'200	700	645	4'255 CHF	104.55%	4'448'602.50	0.12	a)
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	3'680	500	1'300	2'880 CHF	109.75%	3'160'800.00	0.09	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	860	0	0	860 CHF	106.90%	919'340.00	0.03	a)
CH1196217009	1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26	1'540	0	0	1'540 CHF	100.45%	1'546'930.00	0.04	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	1'100	0	245	855 CHF	105.40%	901'170.00	0.02	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	655	0	0	655 CHF	114.05%	747'027.50	0.02	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	1'100	0	160	940 CHF	101.20%	951'280.00	0.03	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	1'200	350	695	855 CHF	105.40%	901'170.00	0.02	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	1'700	500	0	2'200 CHF	99.07%	2'179'540.00	0.06	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	3'800	2'070	3'000	2'870 CHF	105.03%	3'014'361.00	0.08	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	1'200	0	400	800 CHF	99.05%	792'400.00	0.02	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	3'300	500	0	3'800 CHF	99.76%	3'790'880.00	0.10	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	3'300	1'000	1'700	2'600 CHF	100.35%	2'609'100.00	0.07	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'700	0	300	1'400 CHF	98.95%	1'385'300.00	0.04	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	2'500	200	0	2'700 CHF	100.70%	2'718'900.00	0.07	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	2'100	550	790	1'860 CHF	102.80%	1'912'080.00	0.05	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	2'700	0	1'000	1'700 CHF	102.15%	1'736'550.00	0.05	a)
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	2'400	500	800	2'100 CHF	100.20%	2'104'200.00	0.06	a)
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	1'890	0	0	1'890 CHF	101.70%	1'922'130.00	0.05	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	2'200	250	0	2'450 CHF	100.81%	2'469'845.00	0.07	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	2'400	3'300	0	5'700 CHF	104.70%	5'967'900.00	0.16	a)
CH1206367430	2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26	960	0	0	960 CHF	101.45%	973'920.00	0.03	a)
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	1'400	0	500	900 CHF	101.05%	909'450.00	0.02	a)
CH1206367471	2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32	1'200	0	340	860 CHF	105.95%	911'170.00	0.02	a)
CH1206367497	3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27	2'700	200	400	2'500 CHF	105.70%	2'642'500.00	0.07	a)
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	600	1'400	0	2'000 CHF	104.51%	2'090'200.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	2'300	0	0	2'300 CHF	107.35%	2'469'050.00	0.07	a)
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	2'100	700	700	2'100 CHF	103.95%	2'182'950.00	0.06	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	1'100	0	0	1'100 CHF	100.80%	1'108'800.00	0.03	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	2'000	1'700	0	3'700 CHF	100.54%	3'719'980.00	0.10	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	4'200	700	0	4'900 CHF	104.75%	5'132'750.00	0.14	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	2'500	2'150	0	4'650 CHF	110.81%	5'152'665.00	0.14	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	1'360	0	0	1'360 CHF	114.05%	1'551'080.00	0.04	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	2'600	750	1'600	1'750 CHF	101.55%	1'777'125.00	0.05	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	2'000	200	0	2'200 CHF	102.65%	2'258'300.00	0.06	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	2'900	650	840	2'710 CHF	101.65%	2'754'715.00	0.08	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	2'300	500	800	2'000 CHF	98.80%	1'976'000.00	0.05	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	1'300	500	0	1'800 CHF	102.20%	1'839'600.00	0.05	a)
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	900	0	0	900 CHF	99.90%	899'100.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	900	0	0	900 CHF	101.85%	916'650.00	0.03	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	1'200	0	400	800 CHF	101.50%	812'000.00	0.02	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	1'200	0	600	600 CHF	102.95%	617'700.00	0.02	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	3'700	0	200	3'500 CHF	100.40%	3'514'000.00	0.10	a)
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	3'200	150	0	3'350 CHF	104.80%	3'510'800.00	0.10	a)
CH1211713248	3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27	1'300	0	0	1'300 CHF	103.30%	1'342'900.00	0.04	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	2'100	0	200	1'900 CHF	107.20%	2'036'800.00	0.06	a)
CH1214797131	2.0000 % PSYPO 2 08/25/34 728	4'600	1'200	0	5'800 CHF	105.20%	6'101'600.00	0.17	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	900	200	0	1'100 CHF	101.80%	1'119'800.00	0.03	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	1'300	500	500	1'300 CHF	100.80%	1'310'400.00	0.04	a)
CH1214797198	2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30	1'000	0	0	1'000 CHF	104.95%	1'049'500.00	0.03	a)
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	2'910	100	350	2'660 CHF	102.05%	2'714'530.00	0.07	a)
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	1'200	2'850	2'300	1'750 CHF	111.60%	1'953'000.00	0.05	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	1'500	0	345	1'155 CHF	115.70%	1'336'335.00	0.04	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	1'800	0	0	1'800 CHF	102.30%	1'841'400.00	0.05	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	1'400	500	800	1'100 CHF	104.25%	1'146'750.00	0.03	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	1'300	0	1'300 CHF	100.30%	1'303'900.00	0.04	a)
CH1218301955	2.1250 % PSYPO 2 1/8 07/07/32 730	0	4'400	0	4'400 CHF	105.60%	4'646'400.00	0.13	a)
CH1218301963	2.2500 % PSYPO 2 1/4 09/25/37 731	2'300	4'270	0	6'570 CHF	109.49%	7'193'493.00	0.20	a)
CH1221150506	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25	2'900	350	0	3'250 CHF	100.40%	3'263'000.00	0.09	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	780	0	0	780 CHF	124.05%	967'590.00	0.03	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	1'545	0	690	855 CHF	107.05%	915'277.50	0.03	a)
CH1223665063	3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26	1'620	0	0	1'620 CHF	103.70%	1'679'940.00	0.05	a)
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	2'900	650	600	2'950 CHF	104.75%	3'090'125.00	0.08	a)
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	2'000	500	400	2'100 CHF	111.90%	2'349'900.00	0.06	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	2'100	0	400	1'700 CHF	100.45%	1'707'650.00	0.05	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	2'900	250	400	2'750 CHF	103.40%	2'843'500.00	0.08	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	1'500	0	0	1'500 CHF	104.60%	1'569'000.00	0.04	a)
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	900	650	600	950 CHF	101.65%	965'675.00	0.03	a)
CH1230759479	2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24	0	1'360	1'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	1'900	0	0	1'900 CHF	101.80%	1'934'200.00	0.05	a)
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	1'920	595	1'000	1'515 CHF	102.65%	1'555'147.50	0.04	a)
CH1230759560	1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26	2'500	0	0	2'500 CHF	100.85%	2'521'250.00	0.07	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	2'700	500	640	2'560 CHF	104.70%	2'680'320.00	0.07	a)
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	1'200	0	0	1'200 CHF	103.25%	1'239'000.00	0.03	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	0	2'400	300	2'100 CHF	102.95%	2'161'950.00	0.06	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	0	3'800	0	3'800 CHF	106.35%	4'041'300.00	0.11	a)
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	1'800	0	0	1'800 CHF	100.00%	1'800'000.00	0.05	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	2'610	0	1'000	1'610 CHF	100.51%	1'618'211.00	0.04	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	1'800	350	0	2'150 CHF	102.15%	2'196'225.00	0.06	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	5'600	0	0	5'600 CHF	103.34%	5'787'040.00	0.16	a)
CH1232107057	2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27	800	200	0	1'000 CHF	101.45%	1'014'500.00	0.03	a)
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	900	0	200	700 CHF	103.05%	721'350.00	0.02	a)
CH1232107131	2.0500 % WKBNSW 2.05 07/24/28	1'600	450	0	2'050 CHF	102.35%	2'098'175.00	0.06	a)
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	2'100	0	500	1'600 CHF	102.40%	1'638'400.00	0.04	a)
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	1'200	100	0	1'300 CHF	100.70%	1'309'100.00	0.04	a)
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	900	200	200	900 CHF	101.40%	912'600.00	0.02	a)
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	1'500	500	500	1'500 CHF	103.30%	1'549'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	900	0	0	900 CHF	102.25%	920'250.00	0.03	a)
CH1236363433	2.0400 % SLHNXV 2.04 01/26/26	2'160	500	300	2'360 CHF	100.80%	2'378'880.00	0.07	a)
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	1'700	0	0	1'700 CHF	105.50%	1'793'500.00	0.05	a)
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	1'200	0	350	850 CHF	111.00%	943'500.00	0.03	a)
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	1'295	0	0	1'295 CHF	100.05%	1'295'647.50	0.04	a)
CH1239464618	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464626	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	1'935	1'050	0	2'985 CHF	108.47%	3'237'829.50	0.09	a)
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	1'700	0	500	1'200 CHF	110.75%	1'329'000.00	0.04	a)
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	1'700	400	1'300 CHF	120.95%	1'572'350.00	0.04	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	1'360	0	1'360 CHF	104.40%	1'419'840.00	0.04	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	3'800	0	3'800 CHF	102.75%	3'904'500.00	0.11	a)
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	0	1'100	0	1'100 CHF	100.31%	1'103'410.00	0.03	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	4'850	0	4'850 CHF	103.60%	5'024'600.00	0.14	a)
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	4'195	0	4'195 CHF	104.96%	4'403'072.00	0.12	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	2'070	0	2'070 CHF	106.60%	2'206'620.00	0.06	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	845	0	845 CHF	103.70%	876'265.00	0.02	a)
CH1239464782	2.0500 % BQNCHT 2.05 05/24/28	0	1'400	300	1'100 CHF	102.25%	1'124'750.00	0.03	a)
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	0	920	0	920 CHF	102.95%	947'140.00	0.03	a)
CH1239464808	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26 JUN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464816	2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28	0	1'700	0	1'700 CHF	102.05%	1'734'850.00	0.05	a)
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	1'100	2'150	0	3'250 CHF	102.02%	3'315'650.00	0.09	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	4'300	1'400	1'100	4'600 CHF	103.75%	4'772'500.00	0.13	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	1'700	0	300	1'400 CHF	101.45%	1'420'300.00	0.04	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNXV 2.2588 07/26/28	850	2'100	1'000	1'950 CHF	102.70%	2'002'650.00	0.05	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNXV 2.61 01/26/32	1'400	250	0	1'650 CHF	106.45%	1'756'425.00	0.05	a)
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	1'500	600	0	2'100 CHF	101.00%	2'121'000.00	0.06	a)
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	1'400	200	500	1'100 CHF	103.05%	1'133'550.00	0.03	a)
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	2'200	0	220	1'980 CHF	102.55%	2'030'490.00	0.06	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	2'100	500	465	2'135 CHF	105.30%	2'248'155.00	0.06	a)
CH1243651937	2.3500 % KWLLIJ 2.35 03/01/27	1'025	500	0	1'525 CHF	101.90%	1'553'975.00	0.04	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLLIJ 2 3/4 03/01/30	1'470	350	0	1'820 CHF	105.50%	1'920'100.00	0.05	a)
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	3'700	500	0	4'200 CHF	103.25%	4'336'500.00	0.12	a)
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	3'200	2'120	885	4'435 CHF	101.30%	4'492'655.00	0.12	a)
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	900	0	0	900 CHF	104.00%	936'000.00	0.03	a)
CH1248666930	1.8750 % SCMNXV 1 7/8 08/23/30	1'440	150	0	1'590 CHF	102.85%	1'635'315.00	0.04	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	0	965	965	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	3'900	1'000	2'900 CHF	101.78%	2'951'620.00	0.08	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	0	4'100	0	4'100 CHF	104.80%	4'296'800.00	0.12	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	4'700	0	4'700 CHF	107.00%	5'029'000.00	0.14	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	2'025	0	2'025 CHF	101.05%	2'046'262.50	0.06	a)
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	0	2'050	0	2'050 CHF	106.25%	2'178'125.00	0.06	a)
CH1251030123	3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27	0	2'600	500	2'100 CHF	103.70%	2'177'700.00	0.06	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	0	2'300	900	1'400 CHF	107.95%	1'511'300.00	0.04	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	1'035	0	1'035 CHF	103.05%	1'066'567.50	0.03	a)
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	2'050	0	2'050 CHF	101.40%	2'078'700.00	0.06	a)
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	2'200	0	2'200 CHF	103.05%	2'267'100.00	0.06	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	0	1'200	345	855 CHF	102.30%	874'665.00	0.02	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	2'500	0	2'500 CHF	102.20%	2'555'000.00	0.07	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	2'600	335	2'265 CHF	106.35%	2'408'827.50	0.07	a)
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	0	4'500	0	4'500 CHF	104.75%	4'713'750.00	0.13	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	6'060	0	6'060 CHF	106.67%	6'464'202.00	0.18	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	0	2'560	0	2'560 CHF	103.60%	2'652'160.00	0.07	a)
CH1255924479	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29 APR	0	1'120	1'120	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	1'500	0	1'500 CHF	101.15%	1'517'250.00	0.04	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	0	1'600	400	1'200 CHF	102.85%	1'234'200.00	0.03	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	0	1'150	200	950 CHF	104.90%	996'550.00	0.03	a)
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	4'035	4'035	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887360	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 MAY	0	2'610	2'610	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887378	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	0	900	0	900 CHF	102.45%	922'050.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	1'600	0	1'600 CHF	101.20%	1'619'200.00	0.04	a)
CH1264887428	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31 JULY	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887444	2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26	0	1'550	0	1'550 CHF	101.50%	1'573'250.00	0.04	a)
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	0	2'400	0	2'400 CHF	101.20%	2'428'800.00	0.07	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	0	1'700	0	1'700 CHF	100.60%	1'710'200.00	0.05	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	1'500	0	1'500 CHF	101.95%	1'529'250.00	0.04	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	830	0	830 CHF	132.85%	1'102'655.00	0.03	a)
CH1266846992	2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26	0	1'800	0	1'800 CHF	101.25%	1'822'500.00	0.05	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	0	1'700	435	1'265 CHF	108.75%	1'375'687.50	0.04	a)
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	2'230	0	2'230 CHF	101.54%	2'264'342.00	0.06	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	0	2'000	0	2'000 CHF	104.20%	2'084'000.00	0.06	a)
CH1266847156	1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26	0	1'780	0	1'780 CHF	100.85%	1'795'130.00	0.05	a)
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	770	0	770 CHF	108.75%	837'375.00	0.02	a)
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	5'900	0	5'900 CHF	103.35%	6'097'650.00	0.17	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	5'800	700	5'100 CHF	105.10%	5'360'100.00	0.15	a)
CH1266847255	1.8000 % WKBSW 1.8 08/29/29	0	2'200	0	2'200 CHF	102.00%	2'244'000.00	0.06	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	0	4'200	0	4'200 CHF	102.41%	4'301'220.00	0.12	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	5'900	0	5'900 CHF	103.62%	6'113'580.00	0.17	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	4'400	0	4'400 CHF	104.87%	4'614'280.00	0.13	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	0	1'385	0	1'385 CHF	103.55%	1'434'167.50	0.04	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	2'200	345	1'855 CHF	101.00%	1'873'550.00	0.05	a)
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	0	1'300	200	1'100 CHF	103.15%	1'134'650.00	0.03	a)
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	3'650	1'200	2'450 CHF	100.70%	2'467'150.00	0.07	a)
CH1271007911	1.9500 % GLRNKB 1.95 05/09/28	0	1'300	0	1'300 CHF	101.95%	1'325'350.00	0.04	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	780	0	780 CHF	101.20%	789'360.00	0.02	a)
CH1271007945	2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28	0	1'200	0	1'200 CHF	101.85%	1'222'200.00	0.03	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	0	2'850	0	2'850 CHF	102.60%	2'924'100.00	0.08	a)
CH1273475405	2.0000 % NESNVX 2 06/28/33	0	4'000	0	4'000 CHF	104.65%	4'186'000.00	0.11	a)
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	3'700	0	3'700 CHF	107.35%	3'971'950.00	0.11	a)
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	850	0	850 CHF	100.65%	855'525.00	0.02	a)
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	0	900	0	900 CHF	101.70%	915'300.00	0.03	a)
CH1274703136	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47 SEPT	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	2'300	0	2'300 CHF	101.84%	2'342'251.00	0.06	a)
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	0	1'060	0	1'060 CHF	101.27%	1'073'462.00	0.03	a)
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	3'400	3'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	4'600	0	4'600 CHF	107.63%	4'950'980.00	0.14	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	2'600	0	2'600 CHF	109.98%	2'859'480.00	0.08	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	1'500	200	1'300 CHF	101.20%	1'315'600.00	0.04	a)
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	1'400	0	1'400 CHF	104.00%	1'456'000.00	0.04	a)
CH1276313306	2.8422 % ALNOW 2023-2 A	0	1'500	0	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.04	a)
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	4'200	0	4'200 CHF	102.72%	4'314'240.00	0.12	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	1'800	0	1'800 CHF	103.60%	1'864'800.00	0.05	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	2'160	0	2'160 CHF	104.30%	2'252'880.00	0.06	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	2'245	0	2'245 CHF	106.20%	2'384'190.00	0.07	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	0	1'400	0	1'400 CHF	103.50%	1'449'000.00	0.04	a)
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	6'500	0	6'500 CHF	105.75%	6'873'750.00	0.19	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	3'100	0	3'100 CHF	102.72%	3'184'320.00	0.09	a)
CH1280154316	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 SEP	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	1'000	0	1'000 CHF	106.51%	1'065'100.00	0.03	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	0	1'300	0	1'300 CHF	101.95%	1'325'350.00	0.04	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	0	2'100	0	2'100 CHF	102.40%	2'150'400.00	0.06	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	1'500	0	1'500 CHF	101.55%	1'523'250.00	0.04	a)
CH1280994315	3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29	0	1'800	0	1'800 CHF	102.95%	1'853'100.00	0.05	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	0	2'700	300	2'400 CHF	102.10%	2'450'400.00	0.07	a)
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	1'850	250	1'600 CHF	101.70%	1'627'200.00	0.04	a)
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	2'350	415	1'935 CHF	103.25%	1'997'887.50	0.05	a)
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	0	1'900	0	1'900 CHF	106.70%	2'027'300.00	0.06	a)
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	0	1'500	0	1'500 CHF	108.95%	1'634'250.00	0.04	a)
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	0	900	0	900 CHF	115.40%	1'038'600.00	0.03	a)
CH1290222335	2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28	0	1'300	0	1'300 CHF	102.10%	1'327'300.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	0	2'400	390	2'010 CHF	103.05%	2'071'305.00	0.06	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	3'150	0	3'150 CHF	106.20%	3'345'300.00	0.09	a)
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	0	3'450	0	3'450 CHF	89.20%	3'077'400.00	0.08	a)
CH1290222434	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 OCT	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	0	3'200	0	3'200 CHF	103.16%	3'301'120.00	0.09	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'300	0	2'300 CHF	104.85%	2'411'550.00	0.07	a)
CH1290222467	2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26	0	2'100	0	2'100 CHF	101.70%	2'135'700.00	0.06	a)
CH1290222491	2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30	0	1'600	0	1'600 CHF	103.65%	1'658'400.00	0.05	a)
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	0	3'100	0	3'100 CHF	103.30%	3'202'300.00	0.09	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	0	1'800	0	1'800 CHF	106.25%	1'912'500.00	0.05	a)
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	1'500	0	1'500 CHF	101.55%	1'523'250.00	0.04	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	0	1'500	0	1'500 CHF	103.70%	1'555'500.00	0.04	a)
CH1290222558	2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27	0	2'700	0	2'700 CHF	101.55%	2'741'850.00	0.08	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	2'200	0	2'200 CHF	104.50%	2'299'000.00	0.06	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	1'830	0	1'830 CHF	102.75%	1'880'325.00	0.05	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	0	1'620	0	1'620 CHF	105.90%	1'715'580.00	0.05	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	1'600	0	1'600 CHF	102.25%	1'636'000.00	0.04	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	0	3'590	0	3'590 CHF	101.30%	3'636'670.00	0.10	a)
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	3'420	0	3'420 CHF	104.75%	3'582'450.00	0.10	a)
CH1290975528	1.9000 % KBFRIE 1.9 09/08/26	0	1'300	0	1'300 CHF	100.90%	1'311'700.00	0.04	a)
CH1291278088	2.0000 % GRKPSW 2 09/30/41 SEP	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	0	1'800	700	1'100 CHF	101.75%	1'119'250.00	0.03	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	0	2'900	0	2'900 CHF	101.15%	2'933'350.00	0.08	a)
CH1293237983	1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28	0	1'750	250	1'500 CHF	102.15%	1'532'250.00	0.04	a)
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	0	3'100	585	2'515 CHF	104.45%	2'626'917.50	0.07	a)
CH1293238015	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26	0	3'400	500	2'900 CHF	101.80%	2'952'200.00	0.08	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	1'850	350	1'500 CHF	102.60%	1'539'000.00	0.04	a)
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	0	2'100	585	1'515 CHF	104.85%	1'588'477.50	0.04	a)
CH1293714361	2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31	0	1'000	0	1'000 CHF	105.50%	1'055'000.00	0.03	a)
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	1'600	0	1'600 CHF	109.55%	1'752'800.00	0.05	a)
CH1296291003	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 DEC	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291029	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 DEC	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291037	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 DEC	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	3'000	0	3'000 CHF	100.65%	3'019'500.00	0.08	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	5'100	645	4'455 CHF	103.60%	4'615'380.00	0.13	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277782	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 NOV	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277790	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277790XXX	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV *RETIRED*	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	1'900	0	1'900 CHF	104.61%	1'987'590.00	0.05	a)
CH1300277816	1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26	0	900	0	900 CHF	100.80%	907'200.00	0.02	a)
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	0	1'050	0	1'050 CHF	104.15%	1'093'575.00	0.03	a)
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	0	1'550	0	1'550 CHF	101.10%	1'567'050.00	0.04	a)
CH1300277840	1.8750 % NESNVX 1 7/8 11/20/31	0	2'000	0	2'000 CHF	103.30%	2'066'000.00	0.06	a)
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	0	2'150	0	2'150 CHF	105.35%	2'265'025.00	0.06	a)
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	0	1'150	0	1'150 CHF	101.60%	1'168'400.00	0.03	a)
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	0	1'800	0	1'800 CHF	105.15%	1'892'700.00	0.05	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	1'500	0	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.04	a)
CH1300277899	2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31	0	2'000	0	2'000 CHF	104.20%	2'084'000.00	0.06	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	3'125	0	3'125 CHF	105.00%	3'281'250.00	0.09	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	1'500	0	1'500 CHF	101.40%	1'521'000.00	0.04	a)
CH1305916772	1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33	0	2'000	0	2'000 CHF	102.85%	2'057'000.00	0.06	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	2'300	0	2'300 CHF	106.00%	2'438'000.00	0.07	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	3'600	0	3'600 CHF	101.95%	3'670'200.00	0.10	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	1'800	0	1'800 CHF	100.35%	1'806'300.00	0.05	a)
CH1305916848	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 DEC	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	2'800	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117016	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 NOV	0	2'600	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117032	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 NOV	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	1'400	0	1'400 CHF	102.05%	1'428'700.00	0.04	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	1'900	0	1'900 CHF	101.60%	1'930'400.00	0.05	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	0	1'200	0	1'200 CHF	101.70%	1'220'400.00	0.03	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	1'400	0	1'400 CHF	99.84%	1'397'760.00	0.04	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	1'800	0	1'800 CHF	99.95%	1'799'100.00	0.05	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	0	2'600	0	2'600 CHF	99.65%	2'590'900.00	0.07	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	1'200	0	1'200 CHF	100.00%	1'200'000.00	0.03	a)
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	0	675	0	675 CHF	99.95%	674'662.50	0.02	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	600	0	600 CHF	99.75%	598'500.00	0.02	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	1'000	0	1'000 CHF	101.20%	1'012'000.00	0.03	a)
CH1307121264	2.2500 % KWLLIJ 2 1/4 12/05/25	0	900	0	900 CHF	101.05%	909'450.00	0.02	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLLIJ 2 3/8 12/05/29	0	420	0	420 CHF	103.25%	433'650.00	0.01	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	0	2'400	0	2'400 CHF	102.00%	2'448'000.00	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	
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	0	1'600	0	1'600 CHF	99.80%	1'596'800.00	0.04	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	2'200	0	2'200 CHF	101.35%	2'229'700.00	0.06	a)
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	3'700	0	3'700 CHF	102.70%	3'799'900.00	0.10	a)
CH1314941449	2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27	0	900	0	900 CHF	101.20%	910'800.00	0.02	a)
CH1314941456	2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29	0	1'200	0	1'200 CHF	101.65%	1'219'800.00	0.03	a)
CH1314941472	2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30	0	2'400	0	2'400 CHF	101.55%	2'437'200.00	0.07	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	0	1'700	0	1'700 CHF	100.78%	1'713'260.00	0.05	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	0	4'500	0	4'500 CHF	101.10%	4'549'320.00	0.12	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	0	1'100	0	1'100 CHF	101.45%	1'115'950.00	0.03	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	0	3'000	0	3'000 CHF	100.23%	3'006'900.00	0.08	a)
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	2'200	0	2'200 CHF	102.00%	2'244'000.00	0.06	a)
CH1319968462	1.4150 % LUGANO 1.415 03/07/34	0	1'600	0	1'600 CHF	100.00%	1'600'032.00	0.04	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	2'600	0	2'600 CHF	99.80%	2'594'800.00	0.07	a)
CH1319968512	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 MAR	0	1'800	0	1'800 CHF	99.80%	1'796'328.00	0.05	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	4'100	0	4'100 CHF	100.89%	4'136'326.00	0.11	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	2'960	0	2'960 CHF	101.47%	3'003'364.00	0.08	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	1'800	0	1'800 CHF	100.00%	1'800'000.00	0.05	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	2'300	0	2'300 CHF	100.25%	2'305'750.00	0.06	a)
CH1321481488	2.5450 % BOBST 2.545 01/31/29	0	1'890	0	1'890 CHF	101.00%	1'908'900.00	0.05	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	101.00%	2'121'000.00	0.06	a)
CH1323274071	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 FEB	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	3'100	0	3'100 CHF	103.24%	3'200'347.00	0.09	a)
CH1325807837	2.1000 % GRANDX 2.1 03/08/32	0	750	0	750 CHF	101.28%	759'600.00	0.02	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	525	0	525 CHF	102.70%	539'175.00	0.01	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	0	1'300	0	1'300 CHF	100.05%	1'300'689.00	0.04	a)
CH1331440235	1.4500 % KBSCHW 1.45 03/14/31	0	900	0	900 CHF	100.31%	902'808.00	0.02	a)
<b>CHF</b>							<b>3'618'283'331.10</b>	<b>99.03</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	7'832'492.95	0.21
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	3'618'283'331.10	99.03
Sonstige Vermögenswerte	27'631'851.57	0.76
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'653'747'675.62</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-8'750.65	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'653'738'924.97</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	3'618'283'331.10	99.03
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

## Ausgeliehene Effekten

**1'139'278'067.70** **31.18**

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>				<b>1'139'278'067.70</b>	<b>31.18</b>
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	50'360 CHF	112.56%	56'685'216.00	1.55
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	25'099 CHF	171.70%	43'094'983.00	1.18
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	39'874 CHF	123.29%	49'160'654.60	1.35
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	40'524 CHF	119.47%	48'414'022.80	1.33
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	9'200 CHF	103.65%	9'535'800.00	0.26
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	22'400 CHF	107.44%	24'066'560.00	0.66
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	500 CHF	107.38%	536'900.00	0.01
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	1'500 CHF	101.40%	1'521'000.00	0.04
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	800 CHF	108.00%	864'000.00	0.02
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	1'000 CHF	103.70%	1'037'000.00	0.03
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	500 CHF	103.59%	517'950.00	0.01
CH0120736852	2.0000 % KBLUZE 2 12/27/39	1'670 CHF	105.60%	1'763'520.00	0.05
CH0120847899	2.1250 % SGKNSW 2 1/8 12/27/40	300 CHF	107.35%	322'050.00	0.01
CH0125486586	2.5000 % KBLUZE 2 1/2 03/11/43	660 CHF	115.25%	760'650.00	0.02
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	29'900 CHF	110.15%	32'934'850.00	0.90
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	39'029 CHF	111.02%	43'329'995.80	1.19
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	35'905 CHF	105.49%	37'876'184.50	1.04
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	500 CHF	102.08%	510'400.00	0.01
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	500 CHF	116.45%	582'250.00	0.02
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	500 CHF	100.50%	502'500.00	0.01
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.05
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	2'000 CHF	101.15%	2'023'000.00	0.06
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	500 CHF	100.54%	502'700.00	0.01
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	31'140 CHF	100.50%	31'295'700.00	0.86
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	500 CHF	99.50%	497'500.00	0.01
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	1'000 CHF	100.50%	1'005'000.00	0.03
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	500 CHF	100.10%	500'500.00	0.01
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	33'678 CHF	100.51%	33'849'757.80	0.93
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	29'866 CHF	148.54%	44'362'956.40	1.21
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	31'658 CHF	98.17%	31'078'658.60	0.85
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	20'183 CHF	93.55%	18'881'196.50	0.52
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	42'132 CHF	95.64%	40'295'044.80	1.10
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	500 CHF	106.25%	531'250.00	0.01
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	3'000 CHF	106.15%	3'184'500.00	0.09
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	2'500 CHF	111.05%	2'776'250.00	0.08
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	500 CHF	100.62%	503'100.00	0.01
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	1'000 CHF	112.33%	1'123'300.00	0.03
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	195 CHF	100.25%	195'487.50	0.01
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	500 CHF	100.21%	501'050.00	0.01
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'500 CHF	100.73%	1'510'950.00	0.04
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	500 CHF	100.25%	501'250.00	0.01
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	500 CHF	100.20%	501'000.00	0.01
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	500 CHF	99.90%	499'500.00	0.01
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	2'700 CHF	99.45%	2'685'150.00	0.07
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	500 CHF	99.35%	496'750.00	0.01
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	4'175 CHF	99.65%	4'160'387.50	0.11
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	2'500 CHF	99.50%	2'487'500.00	0.07
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	2'000 CHF	100.34%	2'006'800.00	0.05
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	1'500 CHF	98.55%	1'478'250.00	0.04
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	2'000 CHF	97.85%	1'957'000.00	0.05
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	2'105 CHF	91.90%	1'934'495.00	0.05
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	1'760 CHF	96.15%	1'692'240.00	0.05
CH0270191007	1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35	2'985 CHF	95.65%	2'855'152.50	0.08
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	500 CHF	94.10%	470'500.00	0.01
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	500 CHF	95.70%	478'500.00	0.01
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	1'300 CHF	93.97%	1'221'610.00	0.03
CH0276581094	0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25	1'400 CHF	98.40%	1'377'600.00	0.04
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	3'000 CHF	93.10%	2'793'000.00	0.08
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	2'810 CHF	91.50%	2'571'150.00	0.07
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	650 CHF	95.85%	623'025.00	0.02

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	4'500 CHF	96.87%	4'359'150.00	0.12	
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	500 CHF	98.43%	492'150.00	0.01	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	2'000 CHF	95.34%	1'906'800.00	0.05	
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	7'280 CHF	93.15%	6'781'320.00	0.19	
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	500 CHF	96.25%	481'250.00	0.01	
CH0306179125	1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25	45 CHF	99.30%	44'685.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	6'500 CHF	90.67%	5'893'550.00	0.16	
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	400 CHF	99.00%	396'000.00	0.01	
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	2'500 CHF	98.77%	2'469'250.00	0.07	
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	500 CHF	91.12%	455'600.00	0.01	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	700 CHF	89.76%	628'320.00	0.02	
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	1'200 CHF	98.65%	1'183'800.00	0.03	
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	2'000 CHF	90.60%	1'812'000.00	0.05	
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	2'600 CHF	83.65%	2'174'900.00	0.06	
CH0326371462	0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26	1'100 CHF	98.00%	1'078'000.00	0.03	
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	4'500 CHF	84.96%	3'823'200.00	0.10	
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	2'100 CHF	80.65%	1'693'650.00	0.05	
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	500 CHF	84.15%	420'750.00	0.01	
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	1'300 CHF	97.10%	1'262'300.00	0.03	
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	1'500 CHF	82.30%	1'234'500.00	0.03	
CH0336352775	0.1250 % SCMN VX 0 1/8 09/15/32	2'000 CHF	89.20%	1'784'000.00	0.05	
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	6'500 CHF	91.06%	5'918'900.00	0.16	
CH0337172313	0.1000 % KBLUZE 0.1 09/15/31	1'500 CHF	90.05%	1'350'750.00	0.04	
CH0337645532	0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25	1'420 CHF	98.00%	1'391'600.00	0.04	
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	500 CHF	81.41%	407'050.00	0.01	
CH0338330431	0.2000 % LGT 0.2 10/12/26	100 CHF	96.65%	96'650.00	0.00	
CH0343366784	0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.01	
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	2'500 CHF	95.66%	2'391'500.00	0.07	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	26'660 CHF	93.25%	24'860'450.00	0.68	
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	11'500 CHF	93.68%	10'773'200.00	0.29	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	27'234 CHF	97.36%	26'515'022.40	0.73	
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	3'000 CHF	97.75%	2'932'500.00	0.08	
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	5'365 CHF	90.16%	4'837'084.00	0.13	
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	500 CHF	96.00%	480'000.00	0.01	
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	500 CHF	97.00%	485'000.00	0.01	
CH0354836113	0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26	2'500 CHF	97.80%	2'445'000.00	0.07	
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	15 CHF	97.15%	14'572.50	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	1'000 CHF	97.43%	974'300.00	0.03	
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	3'100 CHF	95.15%	2'949'650.00	0.08	
CH0367206718	0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25	1'250 CHF	98.25%	1'228'125.00	0.03	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.03	
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	500 CHF	88.07%	440'350.00	0.01	
CH0372831567	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29	750 CHF	94.35%	707'625.00	0.02	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.03	
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	1'000 CHF	97.55%	975'500.00	0.03	
CH0373476636	1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0	1'400 CHF	97.60%	1'366'400.00	0.04	
CH0373476800	0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25	1'000 CHF	98.88%	988'800.00	0.03	
CH0379268698	0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27	570 CHF	96.10%	547'770.00	0.01	
CH0379268714	0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27	2'000 CHF	96.50%	1'930'000.00	0.05	
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	500 CHF	97.75%	488'750.00	0.01	
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	1'000 CHF	97.10%	971'000.00	0.03	
CH0384125123	0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27	1'000 CHF	96.00%	960'000.00	0.03	
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	2'800 CHF	98.55%	2'759'400.00	0.08	
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	500 CHF	96.40%	482'000.00	0.01	
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.01	
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	500 CHF	97.55%	487'750.00	0.01	
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	500 CHF	95.95%	479'750.00	0.01	
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	1'000 CHF	97.69%	976'900.00	0.03	
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	1'000 CHF	94.71%	947'100.00	0.03	
CH0398678919	0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28	1'020 CHF	96.20%	981'240.00	0.03	
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'350 CHF	96.45%	1'302'075.00	0.04	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	1'000 CHF	98.61%	986'100.00	0.03	
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	900 CHF	98.40%	885'600.00	0.02	
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	500 CHF	94.55%	472'750.00	0.01	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	1'000 CHF	94.55%	945'500.00	0.03	
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	275 CHF	97.65%	268'537.50	0.01	
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	500 CHF	93.00%	465'000.00	0.01	
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	500 CHF	91.15%	455'750.00	0.01	
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	500 CHF	91.10%	455'500.00	0.01	
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	2'000 CHF	98.15%	1'963'000.00	0.05	
CH0419041204	0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26	500 CHF	96.70%	483'500.00	0.01	
CH0419041220	0.5500 % PPSNSW 0.55 02/04/28	500 CHF	95.65%	478'250.00	0.01	
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	4'300 CHF	96.15%	4'134'450.00	0.11	
CH0419041352	0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27	1'100 CHF	95.40%	1'049'400.00	0.03	
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	700 CHF	82.95%	580'650.00	0.02	
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	2'500 CHF	81.74%	2'043'500.00	0.06	
CH0419041485	0.1000 % KBBERN 0.1 09/30/39	1'000 CHF	76.30%	763'000.00	0.02	
CH0419041501	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50	1'100 CHF	63.15%	694'650.00	0.02	
CH0419041659	0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26	1'585 CHF	95.95%	1'520'807.50	0.04	
CH0419042475	0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26	600 CHF	98.05%	588'300.00	0.02	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	1'500 CHF	98.09%	1'471'350.00	0.04	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	500 CHF	96.06%	480'300.00	0.01	
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	500 CHF	92.07%	460'350.00	0.01	
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	915 CHF	98.30%	899'445.00	0.02	
CH0433761308	0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25	2'500 CHF	98.25%	2'456'250.00	0.07	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	500 CHF	98.00%	490'000.00	0.01	
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	500 CHF	94.27%	471'350.00	0.01	
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	500 CHF	96.70%	483'500.00	0.01	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	26'550 CHF	91.96%	24'415'380.00	0.67	
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	25'914 CHF	88.00%	22'804'320.00	0.62	
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	16'900 CHF	109.40%	18'488'600.00	0.51	
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	1'520 CHF	97.15%	1'476'680.00	0.04	
CH0457206818	1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29	1'450 CHF	97.60%	1'415'200.00	0.04	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	1'500 CHF	90.55%	1'358'250.00	0.04	
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	500 CHF	90.60%	453'000.00	0.01	
CH0461239110	0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32	1'000 CHF	89.30%	893'000.00	0.02	
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	500 CHF	91.29%	456'450.00	0.01	
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	500 CHF	97.45%	487'250.00	0.01	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.03	
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	200 CHF	98.55%	197'100.00	0.01	
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.03	
CH0479514314	0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25	1'135 CHF	98.09%	1'113'321.50	0.03	
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	1'500 CHF	84.88%	1'273'200.00	0.03	
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	500 CHF	92.60%	463'000.00	0.01	
CH0484360372	0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN	400 CHF	94.00%	376'000.00	0.01	
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'250 CHF	83.49%	1'043'625.00	0.03	
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	500 CHF	69.65%	348'250.00	0.01	
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	1'000 CHF	94.75%	947'500.00	0.03	
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	110 CHF	95.70%	105'270.00	0.00	
CH0488506665	0.0000 % PPSNSW 0 02/06/30	600 CHF	90.50%	543'000.00	0.01	
CH0488506681	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31	500 CHF	89.60%	448'000.00	0.01	
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	900 CHF	65.05%	585'450.00	0.02	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'000 CHF	94.65%	946'500.00	0.03	
CH0506071130	0.0000 % KBLUZE 0 08/07/28	500 CHF	93.90%	469'500.00	0.01	
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'500 CHF	79.33%	1'983'250.00	0.05	
CH0506071338	0.1250 % KBLUZE 0 1/8 11/25/32	2'000 CHF	88.70%	1'774'000.00	0.05	
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	800 CHF	90.80%	726'400.00	0.02	
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	500 CHF	96.00%	480'000.00	0.01	
CH0515152467	0.1300 % SCMNVX 0.13 09/18/31	500 CHF	90.40%	452'000.00	0.01	
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	500 CHF	87.55%	437'750.00	0.01	
CH0520663672	0.2000 % FHZNSW 0.2 02/26/35	3'200 CHF	85.70%	2'742'400.00	0.08	
CH0522158846	0.2500 % SGKNSW 0 1/4 04/30/35	1'500 CHF	86.65%	1'299'750.00	0.04	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
CH0522158861	0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36	800 CHF	85.50%	684'000.00	0.02
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	500 CHF	91.15%	455'750.00	0.01
CH0522158960	0.3126 % KBFRIB 0.3126 02/02/32	1'680 CHF	90.50%	1'520'400.00	0.04
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	500 CHF	100.75%	503'750.00	0.01
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	2'100 CHF	88.30%	1'854'300.00	0.05
CH0525158447	0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26	520 CHF	97.05%	504'660.00	0.01
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	1'000 CHF	92.31%	923'100.00	0.03
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	1'000 CHF	98.35%	983'500.00	0.03
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	1'000 CHF	90.22%	902'200.00	0.02
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	2'500 CHF	77.70%	1'942'500.00	0.05
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	3'600 CHF	92.51%	3'330'360.00	0.09
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.03
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'300 CHF	90.35%	1'174'550.00	0.03
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	95 CHF	95.25%	90'487.50	0.00
CH0536893339	0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34	1'000 CHF	85.40%	854'000.00	0.02
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	1'000 CHF	85.72%	857'200.00	0.02
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	1'350 CHF	95.03%	1'282'905.00	0.04
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	2'500 CHF	82.60%	2'065'000.00	0.06
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	1'500 CHF	98.35%	1'475'250.00	0.04
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	3'000 CHF	80.02%	2'400'600.00	0.07
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	1'500 CHF	98.35%	1'475'250.00	0.04
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	2'000 CHF	81.65%	1'633'000.00	0.04
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	19'370 CHF	94.18%	18'242'666.00	0.50
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	15'850 CHF	108.04%	17'124'340.00	0.47
CH0561923845	0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25	2'100 CHF	98.15%	2'061'150.00	0.06
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	500 CHF	64.15%	320'750.00	0.01
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	3'500 CHF	80.19%	2'806'650.00	0.08
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	300 CHF	96.70%	290'100.00	0.01
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	105 CHF	90.60%	95'130.00	0.00
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	500 CHF	92.70%	463'500.00	0.01
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	1'705 CHF	87.40%	1'490'170.00	0.04
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	260 CHF	88.00%	228'800.00	0.01
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	400 CHF	84.85%	339'400.00	0.01
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	500 CHF	78.05%	390'250.00	0.01
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	850 CHF	93.75%	796'875.00	0.02
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	1'000 CHF	93.60%	936'000.00	0.03
CH0580464698	1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34	900 CHF	92.60%	833'400.00	0.02
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	500 CHF	87.30%	436'500.00	0.01
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	500 CHF	93.69%	468'450.00	0.01
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	2'500 CHF	84.05%	2'101'250.00	0.06
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	500 CHF	90.77%	453'850.00	0.01
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	500 CHF	95.30%	476'500.00	0.01
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	650 CHF	87.35%	567'775.00	0.02
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	2'000 CHF	89.55%	1'791'000.00	0.05
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	3'000 CHF	92.10%	2'763'000.00	0.08
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	1'000 CHF	89.91%	899'100.00	0.02
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	340 CHF	95.30%	324'020.00	0.01
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	1'000 CHF	91.33%	913'300.00	0.02
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	500 CHF	82.38%	411'900.00	0.01
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	1'400 CHF	93.55%	1'309'700.00	0.04
CH1112455766	0.2500 % SCMNVSX 0 1/4 05/18/33	1'000 CHF	89.10%	891'000.00	0.02
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	2'100 CHF	97.00%	2'037'000.00	0.06
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	1'000 CHF	92.70%	927'000.00	0.03
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	1'100 CHF	89.00%	979'000.00	0.03
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'200 CHF	89.80%	1'077'600.00	0.03
CH1118223523	0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN	1'000 CHF	88.70%	887'000.00	0.02
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	2'000 CHF	78.30%	1'566'000.00	0.04
CH1129053810	0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33	500 CHF	86.20%	431'000.00	0.01
CH1129053828	0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40	600 CHF	77.40%	464'400.00	0.01
CH1130818821	0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25	500 CHF	97.90%	489'500.00	0.01
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	1'675 CHF	90.60%	1'517'550.00	0.04

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	360 CHF	97.60%	351'360.00	0.01	
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	1'055 CHF	83.60%	881'980.00	0.02	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	1'000 CHF	90.80%	908'000.00	0.02	
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	1'260 CHF	91.11%	1'147'986.00	0.03	
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	3'700 CHF	92.50%	3'422'500.00	0.09	
CH1138869784	0.1250 % KBBL 0 1/8 10/06/31	1'500 CHF	90.15%	1'352'250.00	0.04	
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	1'000 CHF	96.10%	961'000.00	0.03	
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	1'300 CHF	74.85%	973'050.00	0.03	
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	1'600 CHF	95.95%	1'535'200.00	0.04	
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	650 CHF	91.33%	593'645.00	0.02	
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	500 CHF	96.50%	482'500.00	0.01	
CH1146382481	0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31	500 CHF	91.50%	457'500.00	0.01	
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	1'000 CHF	94.51%	945'100.00	0.03	
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	1'200 CHF	92.60%	1'111'200.00	0.03	
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	500 CHF	95.65%	478'250.00	0.01	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	990 CHF	92.95%	920'205.00	0.03	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	1'500 CHF	90.50%	1'357'500.00	0.04	
CH1148728194	0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29	1'000 CHF	94.40%	944'000.00	0.03	
CH1148728210	0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27	1'700 CHF	96.25%	1'636'250.00	0.04	
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	700 CHF	94.67%	662'690.00	0.02	
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	1'550 CHF	90.20%	1'398'100.00	0.04	
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	1'500 CHF	94.24%	1'413'600.00	0.04	
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	300 CHF	94.25%	282'750.00	0.01	
CH1163572949	0.6250 % BCG 0 5/8 03/16/29	1'500 CHF	95.30%	1'429'500.00	0.04	
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	500 CHF	97.85%	489'250.00	0.01	
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	3'000 CHF	96.29%	2'888'700.00	0.08	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	1'800 CHF	95.51%	1'719'180.00	0.05	
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	2'000 CHF	97.85%	1'957'000.00	0.05	
CH1172972825	1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26	1'000 CHF	99.35%	993'500.00	0.03	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	925 CHF	97.60%	902'800.00	0.02	
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	550 CHF	97.85%	538'175.00	0.01	
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.01	
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	500 CHF	100.82%	504'100.00	0.01	
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	6'600 CHF	102.24%	6'747'840.00	0.18	
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	4'050 CHF	101.95%	4'128'975.00	0.11	
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	1'350 CHF	99.50%	1'343'250.00	0.04	
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	500 CHF	100.35%	501'750.00	0.01	
CH1191714703	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	0.03	
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	1'500 CHF	100.35%	1'505'250.00	0.04	
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	1'000 CHF	100.05%	1'000'500.00	0.03	
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	500 CHF	105.35%	526'750.00	0.01	
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	300 CHF	101.40%	304'200.00	0.01	
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	4'500 CHF	100.65%	4'529'250.00	0.12	
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	1'500 CHF	99.76%	1'496'400.00	0.04	
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	500 CHF	98.95%	494'750.00	0.01	
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	500 CHF	100.70%	503'500.00	0.01	
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	1'860 CHF	102.80%	1'912'080.00	0.05	
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	1'000 CHF	104.70%	1'047'000.00	0.03	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	900 CHF	101.05%	909'450.00	0.02	
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	1'400 CHF	104.51%	1'463'140.00	0.04	
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	1'000 CHF	107.35%	1'073'500.00	0.03	
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	550 CHF	100.80%	554'400.00	0.02	
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	2'700 CHF	104.75%	2'828'250.00	0.08	
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	4'500 CHF	110.81%	4'986'450.00	0.14	
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	2'500 CHF	100.40%	2'510'000.00	0.07	
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	600 CHF	107.20%	643'200.00	0.02	
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	500 CHF	105.20%	526'000.00	0.01	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	2'660 CHF	102.05%	2'714'530.00	0.07	
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	1'000 CHF	115.70%	1'157'000.00	0.03	
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	3'400 CHF	105.60%	3'590'400.00	0.10	
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	800 CHF	107.05%	856'400.00	0.02	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1226543846	2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35	1'000 CHF	111.90%	1'119'000.00	0.03	
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	1'500 CHF	100.45%	1'506'750.00	0.04	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	250 CHF	103.40%	258'500.00	0.01	
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	500 CHF	104.60%	523'000.00	0.01	
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	1'000 CHF	102.15%	1'021'500.00	0.03	
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	2'000 CHF	103.34%	2'066'800.00	0.06	
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	100 CHF	102.40%	102'400.00	0.00	
CH1232107164	2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26	800 CHF	100.70%	805'600.00	0.02	
CH1232107180	2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32	1'500 CHF	103.30%	1'549'500.00	0.04	
CH1236363433	2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26	500 CHF	100.80%	504'000.00	0.01	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	1'000 CHF	102.75%	1'027'500.00	0.03	
CH1239464717	1.9500 % GLRNKB 1.95 04/04/25	500 CHF	100.31%	501'550.00	0.01	
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	1'000 CHF	104.96%	1'049'600.00	0.03	
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	2'000 CHF	106.60%	2'132'000.00	0.06	
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	500 CHF	102.02%	510'100.00	0.01	
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	100 CHF	106.45%	106'450.00	0.00	
CH1243651903	2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29	1'530 CHF	102.55%	1'569'015.00	0.04	
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	500 CHF	105.30%	526'500.00	0.01	
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	4'435 CHF	101.30%	4'492'655.00	0.12	
CH1243933566	3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29	900 CHF	104.00%	936'000.00	0.03	
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	1'100 CHF	104.80%	1'152'800.00	0.03	
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	1'500 CHF	107.00%	1'605'000.00	0.04	
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.03	
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	1'300 CHF	107.95%	1'403'350.00	0.04	
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	2'200 CHF	103.05%	2'267'100.00	0.06	
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	2'065 CHF	106.35%	2'196'127.50	0.06	
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	4'500 CHF	104.75%	4'713'750.00	0.13	
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	500 CHF	100.60%	503'000.00	0.01	
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	500 CHF	101.95%	509'750.00	0.01	
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	1'000 CHF	101.54%	1'015'400.00	0.03	
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	700 CHF	104.20%	729'400.00	0.02	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	1'000 CHF	103.35%	1'033'500.00	0.03	
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	4'200 CHF	102.41%	4'301'220.00	0.12	
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	1'000 CHF	103.55%	1'035'500.00	0.03	
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	1'000 CHF	101.00%	1'010'000.00	0.03	
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	1'000 CHF	103.15%	1'031'500.00	0.03	
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	700 CHF	101.70%	711'900.00	0.02	
CH1276269748	3.0000 % CRNBK 3 07/14/25	1'060 CHF	101.27%	1'073'462.00	0.03	
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	500 CHF	109.98%	549'900.00	0.02	
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	500 CHF	101.20%	506'000.00	0.01	
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	1'400 CHF	104.00%	1'456'000.00	0.04	
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	500 CHF	103.50%	517'500.00	0.01	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	500 CHF	105.75%	528'750.00	0.01	
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	1'900 CHF	102.72%	1'951'680.00	0.05	
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	800 CHF	101.95%	815'600.00	0.02	
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	1'250 CHF	101.55%	1'269'375.00	0.03	
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	500 CHF	115.40%	577'000.00	0.02	
CH1290222426	2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28	1'490 CHF	89.20%	1'329'080.00	0.04	
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	200 CHF	104.50%	209'000.00	0.01	
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	510 CHF	102.75%	524'025.00	0.01	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	1'250 CHF	104.75%	1'309'375.00	0.04	
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	1'500 CHF	102.60%	1'539'000.00	0.04	
CH1293714353	2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33	1'500 CHF	104.85%	1'572'750.00	0.04	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	500 CHF	104.61%	523'050.00	0.01	
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	1'050 CHF	104.15%	1'093'575.00	0.03	
CH1300277832	1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27	600 CHF	101.10%	606'600.00	0.02	
CH1300277857	2.0000 % NESNVX 2 11/20/36	1'000 CHF	105.35%	1'053'500.00	0.03	
CH1300277865	2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26	1'150 CHF	101.60%	1'168'400.00	0.03	
CH1300277873	2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31	800 CHF	105.15%	841'200.00	0.02	
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.04	
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	500 CHF	101.40%	507'000.00	0.01	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	650 CHF	99.84%	648'960.00	0.02	
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	1'500 CHF	99.95%	1'499'250.00	0.04	
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	1'600 CHF	99.80%	1'596'800.00	0.04	
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	500 CHF	100.78%	503'900.00	0.01	
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	2'000 CHF	101.10%	2'021'920.00	0.06	
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	1'100 CHF	101.45%	1'115'950.00	0.03	
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	1'000 CHF	102.00%	1'020'000.00	0.03	

#### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95288338
-----	---------	------------

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	25'761'174.55	2.134
Bank account	CHF	5'008.05	0.000
Bond	CHF	1'181'436'374.87	97.866
Total	CHF	1'207'202'557.47	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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



## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.42	-	0.241	0.00 - 0.05	-	0.001
GT CHF	CHF	0.00 - 0.42	-	0.241	0.00 - 0.05	-	0.001
NT CHF	CHF	0.00 - 0.42	-	0.241	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.

## 7 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	1'139'278'067.70
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FA CHF	0.160	0.500	0.060	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000

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

## 9 Benchmark

SBI® Domestic AAA-BBB TR

## 10 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.

## 11 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	0.75000	0.26250	0.48750

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT CHF	Nein	CHF	0.83065	0.29072	0.53993
NT CHF	Nein	CHF	1.134	0.396	0.738

## 13 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) \* QUADRATWURZEL(12)

## 14 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 Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle 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 dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

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

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### **Swisscanto (CH) Index Fund V**

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

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 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 CHF) Govt. hedged CHF  
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  
(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert. Dabei sollen folgende Anpassungen vorgenommen werden:

- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll künftig als Zielfonds von einer anderen kollektiven Kapitalanlage der Swisscanto Fondsleitung AG dienen (vgl. Teil 2, Ziff. 1 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll in diesem Zusammenhang daher ebenfalls repositioniert werden (vgl. Teil 2, Ziff. 2 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll umbenannt und der Referenzindex soll gleichzeitig angepasst werden (vgl. Teil 2, Ziff. 3 dieser Veröffentlichung)
- Vereinigungen von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (siehe dazu die Ausführungen unter Teil 2, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

### I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

#### 1 Geplante Vereinigung

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

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	25. Juli 2023

#### 2 Begründung für die Vereinigung

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

#### 3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

#### 4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 25. Juli 2023 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

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

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 25. Juli 2023 umgetauscht. Zudem werden per 25. Juli 2023 Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)</b>	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF</b>	<b>Massnahme</b>	<b>Datum des Umtausches oder der Vereinigung</b>
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)		
FA CHF	FA CHF	Umtausch	25. Juli 2023
DT CHF	FA CHF	Vereinigung	25. Juli 2023
GT CHF	GT CHF	Umtausch	25. Juli 2023
NT CHF	NT CHF	Umtausch	25. Juli 2023



Am Mittwoch, 26. Juli 2023, wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse per Dienstag, 25. Juli 2023, durchgeführt. Am Mittwoch, 26. Juli 2023 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf Dienstag, 25. Juli 2023 (Vereinigungstichtag).

## 5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 22. März 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

## 6 Vollzug der Vereinigung

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

## 7 Kosten

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

## 8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)</b>	20. Juli 2023
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF</b> (übernehmendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)</b>	20. Juli 2023
	<b>Geschlossen (kein Cut Off von/bis)</b>	21. Juli 2023 bis 26. Juli 2023

## 9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

## II Änderungen im Fondsvertrag

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

In § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF nach bildet. Bis anhin war der FTSE Non-CHF World Government Bond Index der massgebende Referenzindex.

## Teil 2 – Repositionierungen bei Teilvermögen, Umbenennung der Bezeichnung bei einem Teilvermögen und Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

### 1 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll neu als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF (neu beantragte Bezeichnung Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I), vgl. nachstehende Ziff. 3 dieser Veröffentlichung) dienen. Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 21, § 15 Ziff. 13 und 22 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen des Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds fungiert, soll gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages).

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

### 2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF als investierende kollektive Kapitalanlage

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll neu in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren können. In diesem Zusammenhang wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren darf (vgl. die Anpassungen in § 8 Ziff. 21 sowie § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages).

Betreffend die weiteren für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF aufgenommenen Anpassungen in § 15 Ziff. 13, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1, welche zum Ziel haben, dass das Teilvermögen in den Zielfonds investieren kann, wird auf die obenstehenden Ausführungen in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung verwiesen.

In § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages wird zudem eine neue Bestimmung aufgenommen, wonach die Fondsleitung für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien desselben Zielfonds angelegt werden darf.

### 3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF sowie entsprechende Anpassung in der Anlagepolitik

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 23 und 27 (nach Vereinigung neue Ziff. 26), § 15 Ziff. 3, 13 und 22, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird auch der Referenzindex entsprechend in § 8 Ziff. 26 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index.

## 4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

### 4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

Per 25. Juli 2023 werden Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt (vgl. unsere Ausführungen in Teil 1, I, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)	
DT CHF	FA CHF	25. Juli 2023

Im Nachgang zur Vereinigung der Teilvermögen werden per 10. August 2023 die Anteile der Klasse DTH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FAH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
FAH1 CHF	DTH1 CHF	10. August 2023

Die jeweilige übertragende Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens wird gemäss der vorstehenden Tabelle, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, mit der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens vereinigt. Das Umtauschverhältnis für den Umtausch von Anteilen der jeweiligen übertragenden Anteilsklasse in Anteile der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse wird jeweils nach Durchführung der Vereinigung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds ([www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com)) veröffentlicht.

### 4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

Für das nachgenannte Teilvermögen sind die folgenden Anteilsklassen im angepassten Fondsvertrag nicht mehr vorgesehen (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages):

Teilvermögen	Anteilsklassen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD

\* \* \*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

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

Zürich, 24. Mai 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

### 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

betreffend

**Einstellung von Zeichnungen und Aufschub von Rückzahlungen von Anteilen des folgenden Teilvermögens des oben genannten Umbrella-Fonds**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)**

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) investiert einen wesentlichen Anteil seines Fondsvermögens in neun 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.) des Umbrella-Fonds *Swisscanto (CH) Index Fund II*, bei welchen im Rahmen der Vereinigung mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während einzelner Tage Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden (vgl. die Publikation vom 18. September 2023 betreffend den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Dies hat zur Folge, dass beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während des folgenden Zeitraums Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden:

<b>Teilvermögen</b>	<b>Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)</b>
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	20. November 2023 bis 24. November 2023

\*\*\*

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

Zürich, 14. November 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich