

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. USD RESPONSIBLE

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FA USD	31562118	USD
NT USD	11705242	USD

Rechnungswährung: USD

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund 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) Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible¹
- ▶ 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 Jahr¹, 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 beigegefügte 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.

¹ 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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	76
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	77
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	77
7	Pauschale Verwaltungskommission	77
8	Benchmark	78
9	TER	78
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	78
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	78
12	Fussnoten	79
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	80
14	Pflichtpublikationen	82

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'601'500'567.10	1'293'633'725.23	1'328'337'672.26	1'627'737'558.96
Klasse FA USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'577'738.57	2'829'807.13	2'364'085.92	2'700'856.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		40'644.400	32'816.805	23'784.805	25'416.718
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		88.0254	86.2304	99.3948	106.2630
Ausschüttung je Anteil		3.40	3.15	3.40	3.40
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %
Klasse NT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'597'922'828.53	1'290'803'918.10	1'325'973'586.34	1'625'036'702.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'425'495.622	10'507'117.960	9'617'942.690	11'273'749.485
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		128.6003	122.8504	137.8646	144.1434
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		113.2390	115.1416	126.4839	130.4930
Thesaurierung je Anteil		5.14	4.70	4.90	4.90
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 USD	5.85 %	8.25 %	-14.98 %	-1.33 %
Klasse NT USD	6.07 %	8.47 %	-14.80 %	-1.13 %
Benchmark	6.09 %	8.60 %	-15.12 %	-1.07 %
Tracking Error ³³⁾	0.22 %	0.22 %	0.26 %	0.10 %

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 USD	-0.24 %
Klasse NT USD	-0.02 %

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	7'530'819.26	6'524'776.22
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'575'436'692.00	1'273'204'351.18
Sonstige Vermögenswerte	18'533'625.48	13'905'037.52
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'601'501'136.74	1'293'634'164.92
Andere Verbindlichkeiten	-569.64	-439.69
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'601'500'567.10	1'293'633'725.23

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA USD	von	01.03.2023	01.03.2022
	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		32'816.805	23'784.805
Ausgegebene Anteile		12'249.595	25'328.000
Zurückgenommene Anteile		-4'422.000	-16'296.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		40'644.400	32'816.805

Klasse NT USD	von	01.03.2023	01.03.2022
	bis	29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'507'117.960	9'617'942.690
Ausgegebene Anteile		2'746'925.419	2'690'239.774
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		569'613.833	567'352.341
Zurückgenommene Anteile		-590'402.336	-1'887'135.439
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-807'759.254	-481'281.406
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'425'495.622	10'507'117.960

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT USD	13.06.2023	1'292'722.57	10'359.184
Klasse NT USD	13.06.2023	20'987'970.25	168'186.315
Klasse NT USD	11.09.2023	10'124'982.37	82'547.526
Klasse NT USD	22.11.2023	1'375'725.52	11'090.366
Klasse NT USD	07.12.2023	32'963'910.54	259'163.076
Klasse NT USD	07.12.2023	4'867'367.87	38'267.366

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT USD	26.06.2023	3'118'136.56	25'066.696
Klasse NT USD	26.06.2023	13'814'350.01	111'053.543
Klasse NT USD	18.09.2023	797'578.68	6'505.886
Klasse NT USD	18.09.2023	3'972'399.95	32'403.049
Klasse NT USD	20.12.2023	69'547'410.51	534'239.953
Klasse NT USD	20.12.2023	12'821'454.58	98'490.127

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von	01.03.2023	01.03.2022
	bis	29.02.2024	28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'293'633'725.23	1'328'337'672.26
Ausbezahlte Ausschüttung		-99'252.74	-131'235.94
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-18'150'288.72	-17'716'036.89
Saldo aus dem Anteilverkehr		234'589'302.87	121'946'168.10
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		91'527'080.46	-138'802'842.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'601'500'567.10	1'293'633'725.23

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		224'300.73	40'658.61
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-418.80
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		58'238'951.60	49'271'582.96
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		10'056'398.14	6'564'674.24
Total Ertrag		68'519'650.47	55'876'497.01
Aufwand			
Passivzinsen		-289.14	-2.36
Reglementarische Vergütungen		-5'875.43	-4'738.24
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-4'486'074.82	-6'307'327.57
Total Aufwand		-4'492'239.39	-6'312'068.17
Nettoertrag / Verlust		64'027'411.08	49'564'428.84
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-14'300'555.04	-19'014'066.63
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'949'582.94	1'601'212.17
Realisierter Erfolg		51'676'438.98	32'151'574.38
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		39'850'641.48	-170'954'416.68
Gesamterfolg		91'527'080.46	-138'802'842.30

Verwendung des Erfolges

Klasse FA USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	137'443.85	103'835.45
Vortrag des Vorjahres	1'067.24	604.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	138'511.09	104'440.18
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	138'190.96	103'372.94
Vortrag auf neue Rechnung	320.13	1'067.24
Total	138'511.09	104'440.18
Klasse NT USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	63'889'967.23	49'460'593.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	63'889'967.23	49'460'593.39
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	22'361'488.53	17'311'207.69
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	41'528'478.70	32'149'385.70
Total	63'889'967.23	49'460'593.39

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 USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							1'575'436'692.00	98.37	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							1'575'436'692.00	98.37	
FR0012990315	4.7500 % EDF 4 3/4 10/06/45 EMTN	0	200	0	200 USD	78.13%	156'250.00	0.01	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	0	600	0	600 USD	70.92%	425'544.00	0.03	a)
IL0028103310	6.3750 % ICLIT 6 3/8 05/31/38	200	500	0	700 USD	95.01%	665'084.00	0.04	a)
US001055AY85	4.7500 % AFL 4 3/4 01/15/49	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US001055BJ00	3.6000 % AFL 3.6 04/01/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00108WAM29	2.1000 % AEP 2.1 07/01/30 I	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00108WAQ33	5.2500 % AEP 5 1/4 05/15/52	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00115AAP49	4.5000 % AEP 4 1/2 06/15/52 O	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00185AAF12	3.5000 % AON 3 1/2 06/14/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00185AAG94	4.6000 % AON 4.6 06/14/44	200	200	0	400 USD	85.79%	343'174.80	0.02	a)
US00185AAH77	4.7500 % AON 4 3/4 05/15/45	500	0	0	500 USD	88.08%	440'395.50	0.03	a)
US00206RAG74	6.3000 % T 6.3 01/15/38	0	100	0	100 USD	105.31%	105'314.60	0.01	a)
US00206RBH49	4.3000 % T 4.3 12/15/42	470	0	0	470 USD	84.28%	396'108.01	0.02	a)
US00206RBK77	4.3500 % T 4.35 06/15/45	650	0	0	650 USD	83.67%	543'858.90	0.03	a)
US00206RCP55	4.5000 % T 4 1/2 05/15/35	600	0	0	600 USD	92.23%	553'363.80	0.03	a)
US00206RCQ39	4.7500 % T 4 3/4 05/15/46	450	0	0	450 USD	87.78%	395'025.75	0.02	a)
US00206RCU41	5.6500 % T 5.65 02/15/47	0	500	0	500 USD	100.27%	501'368.00	0.03	a)
US00206RDJ86	4.5000 % T 4 1/2 03/09/48	548	0	0	548 USD	83.79%	459'181.80	0.03	a)
US00206RDK59	4.5500 % T 4.55 03/09/49	267	0	0	267 USD	84.42%	225'408.08	0.01	a)
US00206RDQ20	4.2500 % T 4 1/4 03/01/27	1'000	0	0	1'000 USD	97.65%	976'475.00	0.06	a)
US00206RFW79	4.9000 % T 4.9 08/15/37	1'000	0	0	1'000 USD	93.95%	939'525.00	0.06	a)
US00206RGL06	4.1000 % T 4.1 02/15/28	495	0	0	495 USD	96.20%	476'188.02	0.03	a)
US00206RGQ92	4.3000 % T 4.3 02/15/30	1'240	400	0	1'640 USD	95.56%	1'567'151.20	0.10	a)
US00206RHK14	4.8500 % T 4.85 03/01/39	0	100	0	100 USD	92.53%	92'526.50	0.01	a)
US00206RHW51	3.8000 % T 3.8 02/15/27	500	0	0	500 USD	96.55%	482'769.00	0.03	a)
US00206RJX17	2.3000 % T 2.3 06/01/27	0	710	0	710 USD	91.40%	648'945.68	0.04	a)
US00206RJY99	2.7500 % T 2 3/4 06/01/31	1'000	0	0	1'000 USD	84.92%	849'150.00	0.05	a)
US00206RJZ64	3.5000 % T 3 1/2 06/01/41	0	800	0	800 USD	76.37%	610'945.60	0.04	a)
US00206RKA94	3.6500 % T 3.65 06/01/51	1'000	300	0	1'300 USD	71.61%	930'883.20	0.06	a)
US00206RKB77	3.8500 % T 3.85 06/01/60	0	400	0	400 USD	70.94%	283'774.40	0.02	a)
US00206RKE17	3.3000 % T 3.3 02/01/52	500	0	0	500 USD	68.26%	341'305.00	0.02	a)
US00206RKF81	3.5000 % T 3 1/2 02/01/61	500	200	0	700 USD	67.03%	469'204.40	0.03	a)
US00206RKG64	1.6500 % T 1.65 02/01/28	700	0	0	700 USD	87.98%	615'852.30	0.04	a)
US00206RKH48	2.2500 % T 2 1/4 02/01/32	1'000	0	0	1'000 USD	80.05%	800'465.00	0.05	a)
US00206RKJ04	3.5000 % T 3 1/2 09/15/53	2'132	0	0	2'132 USD	69.10%	1'473'303.68	0.09	a)
US00206RLJ94	3.5500 % T 3.55 09/15/55	2'894	0	0	2'894 USD	68.24%	1'974'961.10	0.12	a)
US00206RLV23	3.6500 % T 3.65 09/15/59	4'447	0	0	4'447 USD	67.89%	3'019'241.73	0.19	a)
US00206RML32	1.7000 % T 1.7 03/25/26	1'000	0	0	1'000 USD	93.17%	931'702.00	0.06	a)
US00206RMM15	2.5500 % T 2.55 12/01/33	1'000	0	0	1'000 USD	78.80%	788'007.00	0.05	a)
US00206RMM97	3.8000 % T 3.8 12/01/57	0	500	0	500 USD	70.62%	353'122.50	0.02	a)
US00206RMP46	5.5390 % T 5.539 02/20/26	0	540	0	540 USD	99.66%	538'169.94	0.03	a)
US00206RMT67	5.4000 % T 5.4 02/15/34	0	804	0	804 USD	99.88%	803'032.79	0.05	a)
US00217GAA13	2.3960 % APTV 2.396 02/18/25	250	0	0	250 USD	96.75%	241'863.50	0.02	a)
US00217GAB95	3.2500 % APTV 3 1/4 03/01/32	250	0	0	250 USD	85.80%	214'510.75	0.01	a)
US00217GAC78	4.1500 % APTV 4.15 05/01/52	250	100	0	350 USD	76.32%	267'111.25	0.02	a)
US002824AV29	6.0000 % ABT 6 04/01/39	240	0	0	240 USD	109.72%	263'319.84	0.02	a)
US002824BB55	2.9500 % ABT 2.95 03/15/25	250	0	0	250 USD	97.76%	244'401.50	0.02	a)
US002824BF69	3.7500 % ABT 3 3/4 11/30/26	509	0	0	509 USD	97.45%	496'032.21	0.03	a)
US002824BG43	4.7500 % ABT 4 3/4 11/30/36	700	0	0	700 USD	97.84%	684'872.30	0.04	a)
US002824BH26	4.9000 % ABT 4.9 11/30/46	1'250	0	0	1'250 USD	96.78%	1'209'743.75	0.08	a)
US00287YAM12	4.4000 % ABBV 4.4 11/06/42	900	0	0	900 USD	89.58%	806'241.60	0.05	a)
US00287YAQ26	3.6000 % ABBV 3.6 05/14/25	1'150	0	0	1'150 USD	98.02%	1'127'213.90	0.07	a)
US00287YAR09	4.5000 % ABBV 4 1/2 05/14/35	1'500	0	0	1'500 USD	95.53%	1'432'995.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US00287YAS81	4.7000 % ABBV 4.7 05/14/45	1'100	0	0	1'100 USD	92.50%	1'017'451.60	0.06	a)
US00287YAV11	4.3000 % ABBV 4.3 05/14/36	550	0	0	550 USD	93.30%	513'154.95	0.03	a)
US00287YAW93	4.4500 % ABBV 4.45 05/14/46	750	0	0	750 USD	88.62%	664'667.25	0.04	a)
US00287YBD04	4.8750 % ABBV 4 7/8 11/14/48	1'500	0	0	1'500 USD	94.55%	1'418'190.00	0.09	a)
US00287YBF51	4.2500 % ABBV 4 1/4 11/14/28	1'600	0	0	1'600 USD	97.78%	1'564'467.20	0.10	a)
US00287YBV02	2.9500 % ABBV 2.95 11/21/26	1'000	0	0	1'000 USD	94.82%	948'236.00	0.06	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	0	400	0	400 USD	91.64%	366'554.00	0.02	a)
US00287YBZ16	2.6000 % ABBV 2.6 11/21/24	1'900	0	0	1'900 USD	98.02%	1'862'361.00	0.12	a)
US00287YCV92	3.8500 % ABBV 3.85 06/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00287YCX58	3.8000 % ABBV 3.8 03/15/25	1'800	0	0	1'800 USD	98.39%	1'770'969.60	0.11	a)
US00287YCY32	4.5500 % ABBV 4.55 03/15/35	400	0	0	400 USD	96.04%	384'163.20	0.02	a)
US00287YDA47	4.8500 % ABBV 4.85 06/15/44	350	0	0	350 USD	95.09%	332'820.60	0.02	a)
US00440EAR80	3.3500 % CB 3.35 05/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00440EAS63	3.1500 % CB 3.15 03/15/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00440EAV92	3.3500 % CB 3.35 05/03/26	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00440EAW75	4.3500 % CB 4.35 11/03/45	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00507VAK52	3.4000 % ATVI 3.4 09/15/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00507VAP40	1.3500 % ATVI 1.35 09/15/30	0	140	140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00507VAQ23	2.5000 % ATVI 2 1/2 09/15/50	0	430	430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00510RAD52	2.1500 % AYI 2.15 12/15/30	0	150	0	150 USD	81.82%	122'726.10	0.01	a)
US00724FAC59	3.2500 % ADBE 3 1/4 02/01/25	200	0	0	200 USD	98.19%	196'377.20	0.01	a)
US00724PAB58	1.9000 % ADBE 1.9 02/01/25	750	0	0	750 USD	96.92%	726'881.25	0.05	a)
US00724PAC32	2.1500 % ADBE 2.15 02/01/27	300	0	0	300 USD	93.28%	279'836.40	0.02	a)
US00724PAD15	2.3000 % ADBE 2.3 02/01/30	250	0	0	250 USD	87.21%	218'037.25	0.01	a)
US00774MAB19	3.6500 % AER 3.65 07/21/27	1'500	0	0	1'500 USD	94.01%	1'410'156.00	0.09	a)
US00774MAE57	3.8750 % AER 3 7/8 01/23/28	1'050	0	0	1'050 USD	94.24%	989'533.65	0.06	a)
US00774MAN56	6.5000 % AER 6 1/2 07/15/25	1'500	0	0	1'500 USD	100.89%	1'513'375.50	0.09	a)
US00774MAS44	1.7500 % AER 1 3/4 01/30/26	500	0	0	500 USD	92.89%	464'430.50	0.03	a)
US00774MAU99	1.6500 % AER 1.65 10/29/24	500	0	0	500 USD	97.31%	486'565.00	0.03	a)
US00774MAX39	3.3000 % AER 3.3 01/30/32	500	0	0	500 USD	84.37%	421'869.00	0.03	a)
US00774MAY12	3.4000 % AER 3.4 10/29/33	1'750	0	0	1'750 USD	82.97%	1'451'969.75	0.09	a)
US00774MAZ86	3.8500 % AER 3.85 10/29/41	398	0	0	398 USD	77.65%	309'054.96	0.02	a)
US00774MBB00	1.7500 % AER 1 3/4 10/29/24 3NC1	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00774MBC82	5.7500 % AER 5 3/4 06/06/28	0	250	0	250 USD	100.82%	252'037.50	0.02	a)
US00774MBD65	6.1000 % AER 6.1 01/15/27	0	250	0	250 USD	101.29%	253'216.75	0.02	a)
US00774MBE49	6.1500 % AER 6.15 09/30/30	0	250	0	250 USD	103.31%	258'269.75	0.02	a)
US00774MBF14	6.4500 % AER 6.45 04/15/27 144A	0	400	0	400 USD	102.34%	409'345.20	0.03	a)
US007903BF39	3.9240 % AMD 3.924 06/01/32	300	0	0	300 USD	93.54%	280'628.10	0.02	a)
US007903BG12	4.3930 % AMD 4.393 06/01/52	200	0	0	200 USD	88.19%	176'374.40	0.01	a)
US007924AJ23	5.5000 % AEGON 5 1/2 04/11/48	1'500	0	0	1'500 USD	95.88%	1'438'125.00	0.09	a)
US00817YAF51	6.6250 % AET 6 5/8 06/15/36	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00817YAQ17	3.5000 % AET 3 1/2 11/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00817YAZ16	3.8750 % AET 3 7/8 08/15/47	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00846UAN19	2.3000 % A 2.3 03/12/31	500	0	0	500 USD	83.29%	416'438.00	0.03	a)
US00912XAN49	4.2500 % AL 4 1/4 09/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00912XAV64	3.6250 % AL 3 5/8 04/01/27	750	0	0	750 USD	95.09%	713'174.25	0.04	a)
US00912XAY04	3.6250 % AL 3 5/8 12/01/27	300	0	0	300 USD	93.73%	281'193.60	0.02	a)
US00912XBF06	4.6250 % AL 4 5/8 10/01/28	250	0	0	250 USD	96.74%	241'851.75	0.02	a)
US00914AAG76	3.0000 % AL 3 02/01/30 MTN	0	200	0	200 USD	86.94%	173'889.00	0.01	a)
US00914AAJ16	2.8750 % AL 2 7/8 01/15/26 MTN	300	0	0	300 USD	95.29%	285'879.60	0.02	a)
US00914AAM45	1.8750 % AL 1 7/8 08/15/26	500	0	0	500 USD	91.75%	458'772.00	0.03	a)
US00914AAQ58	2.1000 % AL 2.1 09/01/28	0	200	0	200 USD	86.64%	173'283.40	0.01	a)
US00914AAR32	2.2000 % AL 2.2 01/15/27	0	200	0	200 USD	91.53%	183'050.80	0.01	a)
US00914AAS15	2.8750 % AL 2 7/8 01/15/32 MTN	500	0	0	500 USD	82.91%	414'541.00	0.03	a)
US00914AAT97	5.8500 % AL 5.85 12/15/27	250	0	0	250 USD	101.20%	252'999.00	0.02	a)
US00914AAU60	5.3000 % AL 5.3 02/01/28	0	200	0	200 USD	99.54%	199'081.40	0.01	a)
US009158BA32	2.8000 % APD 2.8 05/15/50	0	300	0	300 USD	66.37%	199'123.50	0.01	a)
US009158BC97	2.0500 % APD 2.05 05/15/30	0	350	0	350 USD	85.02%	297'572.80	0.02	a)
US00928QAS03	4.2500 % AYR 4 1/4 06/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US012653AD34	4.6500 % ALB 4.65 06/01/27	200	0	0	200 USD	98.00%	196'005.20	0.01	a)
US012653AE17	5.0500 % ALB 5.05 06/01/32	250	0	0	250 USD	94.74%	236'855.25	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US012873AK13	7.3750 % OVV 7 3/8 11/01/31	100	0	0	100 USD	109.15%	109'147.40	0.01	a)
US013716AU93	6.1250 % RIOLN 6 1/8 12/15/33	100	0	0	100 USD	106.41%	106'414.70	0.01	a)
US015271AL39	3.4500 % ARE 3.45 04/30/25	300	0	0	300 USD	97.66%	292'981.20	0.02	a)
US015271AR09	3.3750 % ARE 3 3/8 08/15/31	0	200	0	200 USD	87.97%	175'941.40	0.01	a)
US015271AS81	4.0000 % ARE 4 02/01/50	0	250	0	250 USD	75.61%	189'027.25	0.01	a)
US015271AV11	1.8750 % ARE 1 7/8 02/01/33	500	0	0	500 USD	75.02%	375'078.00	0.02	a)
US015271AW93	2.0000 % ARE 2 05/18/32	500	0	0	500 USD	77.42%	387'112.00	0.02	a)
US015271AX76	3.0000 % ARE 3 05/18/51	500	0	0	500 USD	62.90%	314'511.50	0.02	a)
US015271AY59	2.9500 % ARE 2.95 03/15/34	0	200	0	200 USD	80.84%	161'670.20	0.01	a)
US015271AZ25	3.5500 % ARE 3.55 03/15/52	250	200	0	450 USD	68.95%	310'261.50	0.02	a)
US015271BA64	4.7500 % ARE 4 3/4 04/15/35	0	200	0	200 USD	93.25%	186'500.00	0.01	a)
US015271BB48	5.1500 % ARE 5.15 04/15/53	0	200	0	200 USD	90.74%	181'489.00	0.01	a)
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	600	0	600 USD	94.47%	566'826.60	0.04	a)
US01609WAU62	4.0000 % BABA 4 12/06/37	0	200	0	200 USD	86.07%	172'148.60	0.01	a)
US01609WAV46	4.2000 % BABA 4.2 12/06/47	0	500	0	500 USD	80.78%	403'892.50	0.03	a)
US01609WAW29	4.4000 % BABA 4.4 12/06/57	0	300	0	300 USD	80.95%	242'855.40	0.02	a)
US01609WAX02	2.1250 % BABA 2 1/8 02/09/31	0	600	0	600 USD	82.59%	495'556.20	0.03	a)
US01609WAY84	2.7000 % BABA 2.7 02/09/41	0	300	0	300 USD	68.63%	205'883.70	0.01	a)
US01609WAZ59	3.1500 % BABA 3.15 02/09/51	0	500	0	500 USD	65.79%	328'935.50	0.02	a)
US01609WBA99	3.2500 % BABA 3 1/4 02/09/61	0	300	0	300 USD	63.16%	189'465.90	0.01	a)
US01748TAC53	5.4110 % ALLE 5.411 07/01/32	200	0	0	200 USD	99.92%	199'844.60	0.01	a)
US020002AS04	5.5500 % ALL 5.55 05/09/35	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US020002BA86	4.5000 % ALL 4 1/2 06/15/43	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US020002BC43	4.2000 % ALL 4.2 12/15/46	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US020002BD26	3.2800 % ALL 3.28 12/15/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US020002BK68	5.2500 % ALL 5 1/4 03/30/33	0	220	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02005NBJ81	5.8000 % ALLY 5.8 05/01/25	0	600	0	600 USD	99.82%	598'932.60	0.04	a)
US02005NBQ25	4.7500 % ALLY 4 3/4 06/09/27	0	300	0	300 USD	97.17%	291'521.10	0.02	a)
US02005NBR08	7.1000 % ALLY 7.1 11/15/27	0	200	0	200 USD	104.16%	208'325.00	0.01	a)
US02005NBS80	6.7000 % ALLY 6.7 02/14/33	0	250	0	250 USD	98.21%	245'524.75	0.02	a)
US02005NBT63	6.9920 % ALLY 6.992 06/13/29	0	500	0	500 USD	102.82%	514'108.50	0.03	a)
US02005NBU37	6.8480 % ALLY 6.848 01/03/30	0	300	0	300 USD	101.76%	305'280.60	0.02	a)
US02079KAC18	1.9980 % GOOGL 1.998 08/15/26	600	250	0	850 USD	94.06%	799'519.35	0.05	a)
US02079KAD90	1.1000 % GOOGL 1.1 08/15/30	500	0	0	500 USD	81.04%	405'199.00	0.03	a)
US02079KAF49	2.0500 % GOOGL 2.05 08/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	59.27%	592'747.00	0.04	a)
US02079KAG22	2.2500 % GOOGL 2 1/4 08/15/60	500	0	0	500 USD	57.45%	287'251.50	0.02	a)
US02079KAH05	0.4500 % GOOGL 0.45 08/15/25	500	0	0	500 USD	94.04%	470'208.50	0.03	a)
US02079KAJ60	0.8000 % GOOGL 0.8 08/15/27	600	0	0	600 USD	88.30%	529'825.20	0.03	a)
US02209SAM52	4.2500 % MO 4 1/4 08/09/42	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SAQ66	4.5000 % MO 4 1/2 05/02/43	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SAR40	5.3750 % MO 5 3/8 01/31/44	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SAU78	2.6250 % MO 2 5/8 09/16/26	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SAV51	3.8750 % MO 3 7/8 09/16/46	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBC61	4.4000 % MO 4.4 02/14/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBD45	4.8000 % MO 4.8 02/14/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBF92	5.9500 % MO 5.95 02/14/49	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBJ15	3.4000 % MO 3.4 05/06/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02209SBL60	2.4500 % MO 2.45 02/04/32	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135AN60	3.8000 % AMZN 3.8 12/05/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135AP19	4.8000 % AMZN 4.8 12/05/34	900	400	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135AQ91	4.9500 % AMZN 4.95 12/05/44	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135AZ90	2.8000 % AMZN 2.8 08/22/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BF28	3.8750 % AMZN 3 7/8 08/22/37	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BJ40	4.0500 % AMZN 4.05 08/22/47	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BM78	4.2500 % AMZN 4 1/4 08/22/57	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BQ82	0.8000 % AMZN 0.8 06/03/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BS49	1.5000 % AMZN 1 1/2 06/03/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BT22	2.5000 % AMZN 2 1/2 06/03/50	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BU94	2.7000 % AMZN 2.7 06/03/60	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BW50	0.4500 % AMZN 0.45 05/12/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US023135BX34	1.0000 % AMZN 1 05/12/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	0	660	660	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135BZ81	2.1000 % AMZN 2.1 05/12/31	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CC87	3.2500 % AMZN 3 1/4 05/12/61	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CF19	3.3000 % AMZN 3.3 04/13/27	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CH74	3.6000 % AMZN 3.6 04/13/32	0	728	728	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CJ31	3.9500 % AMZN 3.95 04/13/52	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CK04	4.1000 % AMZN 4.1 04/13/62	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CP90	4.5500 % AMZN 4.55 12/01/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US023135CQ73	4.6500 % AMZN 4.65 12/01/29	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02343JAA88	4.0000 % AMCR 4 05/17/25	200	0	0	200 USD	98.04%	196'078.40	0.01 a)	
US02343UAJ43	5.6250 % AMCR 5 5/8 05/26/33	0	150	0	150 USD	101.29%	151'933.05	0.01 a)	
US02344AAA60	2.6900 % AMCR 2.69 05/25/31	500	0	0	500 USD	84.60%	423'014.00	0.03 a)	
US023551AJ38	7.3000 % HES 7.3 08/15/31	100	0	0	100 USD	112.53%	112'533.50	0.01 a)	
US023608AJ15	3.5000 % AEE 3 1/2 01/15/31	0	200	0	200 USD	89.83%	179'669.20	0.01 a)	
US023608AP74	5.7000 % AEE 5.7 12/01/26	0	200	0	200 USD	100.99%	201'987.20	0.01 a)	
US02361DAY67	3.8500 % AEE 3.85 09/01/32	0	150	0	150 USD	91.06%	136'584.45	0.01 a)	
US02361DBA72	4.9500 % AEE 4.95 06/01/33	0	200	0	200 USD	98.46%	196'912.40	0.01 a)	
US02364WAJ45	6.3750 % AMXLMM 6 3/8 03/01/35	290	600	0	890 USD	107.83%	959'642.50	0.06 a)	
US02364WAW55	6.1250 % AMXLMM 6 1/8 03/30/40	800	100	0	900 USD	104.64%	941'740.20	0.06 a)	
US02364WBE49	4.3750 % AMXLMM 4 3/8 07/16/42	350	0	0	350 USD	86.27%	301'935.20	0.02 a)	
US02364WBH79	3.6250 % AMXLMM 3 5/8 04/22/29	0	290	0	290 USD	92.90%	269'416.09	0.02 a)	
US02364WBJ36	2.8750 % AMXLMM 2 7/8 05/07/30	0	300	0	300 USD	87.66%	262'976.70	0.02 a)	
US02364WBK09	4.7000 % AMXLMM 4.7 07/21/32	400	0	0	400 USD	96.06%	384'244.80	0.02 a)	
US025537AU52	3.8750 % AEP 3 7/8 02/15/62	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025537AX91	5.6250 % AEP 5 5/8 03/01/33	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816BF52	4.0500 % AXP 4.05 12/03/42	500	200	0	700 USD	86.12%	602'858.20	0.04 a)	
US025816BK48	3.6250 % AXP 3 5/8 12/05/24	350	0	0	350 USD	98.61%	345'124.50	0.02 a)	
US025816BR90	3.0000 % AXP 3 10/30/24	500	0	0	500 USD	98.36%	491'815.00	0.03 a)	
US025816CA56	4.2000 % AXP 4.2 11/06/25	500	0	0	500 USD	98.71%	493'556.00	0.03 a)	
US025816CC13	3.4000 % AXP 3.4 02/22/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816CF44	3.1250 % AXP 3 1/8 05/20/26	500	0	0	500 USD	96.04%	480'182.00	0.03 a)	
US025816CG27	2.5000 % AXP 2 1/2 07/30/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816CP26	3.3000 % AXP 3.3 05/03/27	500	0	0	500 USD	94.95%	474'726.00	0.03 a)	
US025816CS64	2.5500 % AXP 2.55 03/04/27	500	0	0	500 USD	92.83%	464'154.50	0.03 a)	
US025816CW76	4.0500 % AXP 4.05 05/03/29	500	0	0	500 USD	96.79%	483'927.50	0.03 a)	
US025816CY33	3.9500 % AXP 3.95 08/01/25	0	200	0	200 USD	98.24%	196'483.60	0.01 a)	
US025816DA48	4.4200 % AXP 4.42 08/03/33	350	0	0	350 USD	94.45%	330'577.10	0.02 a)	
US025816DB21	5.8500 % AXP 5.85 11/05/27	400	0	0	400 USD	102.43%	409'718.80	0.03 a)	
US025816DC04	4.9000 % AXP 4.9 02/13/26	0	350	0	350 USD	99.70%	348'934.25	0.02 a)	
US025816DE69	4.9900 % AXP 4.99 05/01/26	0	300	0	300 USD	99.44%	298'330.50	0.02 a)	
US025816DF35	5.0430 % AXP 5.043 05/01/34	0	400	0	400 USD	97.88%	391'522.00	0.02 a)	
US025816DG18	5.3890 % AXP 5.389 07/28/27	0	350	0	350 USD	100.11%	350'381.85	0.02 a)	
US025816DH90	5.2820 % AXP 5.282 07/27/29	0	430	0	430 USD	100.66%	432'828.97	0.03 a)	
US025816DL03	6.3380 % AXP 6.338 10/30/26	0	350	0	350 USD	101.53%	355'357.10	0.02 a)	
US025816DN68	6.4890 % AXP 6.489 10/30/31	0	300	0	300 USD	106.43%	319'293.30	0.02 a)	
US02665WCE93	3.5000 % HNDA 3 1/2 02/15/28 GMTN	400	0	0	400 USD	94.99%	379'973.60	0.02 a)	
US02665WCZ23	2.4000 % HNDA 2.4 06/27/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02665WDJ71	2.3500 % HNDA 2.35 01/08/27 MTN	250	0	0	250 USD	93.31%	233'285.75	0.01 a)	
US02665WDT53	1.8000 % HNDA 1.8 01/13/31 MTN	500	0	0	500 USD	82.26%	411'299.50	0.03 a)	
US02665WDY49	0.7500 % HNDA 0 3/4 08/09/24 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US02665WDZ14	1.3000 % HNDA 1.3 09/09/26 MTN	600	0	0	600 USD	91.30%	547'818.00	0.03 a)	
US02665WEA53	1.5000 % HNDA 1 1/2 01/13/25 MTN	500	0	0	500 USD	96.84%	484'200.00	0.03 a)	
US02665WEB37	2.2500 % HNDA 2 1/4 01/12/29 MTN	0	150	0	150 USD	88.81%	133'215.15	0.01 a)	
US02665WEC10	4.7500 % HNDA 4 3/4 01/12/26	0	200	0	200 USD	99.36%	198'716.80	0.01 a)	
US02665WED92	4.7000 % HNDA 4.7 01/12/28	0	150	0	150 USD	99.54%	149'307.60	0.01 a)	
US02665WEH07	4.6000 % HNDA 4.6 04/17/30	0	200	0	200 USD	97.75%	195'500.80	0.01 a)	
US02665WEK36	5.2500 % HNDA 5 1/4 07/07/26 GMTN	0	270	0	270 USD	100.79%	272'133.81	0.02 a)	
US02665WEM91	5.1250 % HNDA 5 1/8 07/07/28 GMTN	0	225	0	225 USD	100.72%	226'624.50	0.01 a)	
US02665WEQ06	5.8000 % HNDA 5.8 10/03/25 GMTN	0	500	0	500 USD	100.92%	504'578.00	0.03 a)	
US02665WEV90	5.6500 % HNDA 5.65 11/15/28	0	300	0	300 USD	102.95%	308'844.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US02665WEY30	4.9500 % HNDA 4.95 01/09/26 GMTN	0	250	0	250 USD	99.68%	249'189.75	0.02	a)
US02665WEZ05	4.9000 % HNDA 4.9 01/10/34 GMTN	0	200	0	200 USD	97.24%	194'489.40	0.01	a)
US026874DA29	4.5000 % AIG 4 1/2 07/16/44	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DC84	3.8750 % AIG 3 7/8 01/15/35	290	0	290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DH71	3.9000 % AIG 3.9 04/01/26	132	0	132	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DL83	4.7500 % AIG 4 3/4 04/01/48	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DP97	4.3750 % AIG 4 3/8 06/30/50	290	0	290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DQ70	2.5000 % AIG 2 1/2 06/30/25	177	0	177	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US026874DS37	5.1250 % AIG 5 1/8 03/27/33	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAD21	5.0000 % AMT 5 02/15/24	390	0	390	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAG51	4.0000 % AMT 4 06/01/25	600	0	0	600 USD	98.05%	588'327.00	0.04	a)
US03027XAJ90	4.4000 % AMT 4.4 02/15/26	300	0	0	300 USD	98.30%	294'897.00	0.02	a)
US03027XAK63	3.3750 % AMT 3 3/8 10/15/26	700	0	0	700 USD	95.47%	668'276.70	0.04	a)
US03027XAP50	3.5500 % AMT 3.55 07/15/27	500	0	0	500 USD	94.77%	473'855.00	0.03	a)
US03027XAT72	3.3750 % AMT 3 3/8 05/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03027XAV29	2.9500 % AMT 2.95 01/15/25	750	0	0	750 USD	97.76%	733'192.50	0.05	a)
US03027XAW02	3.8000 % AMT 3.8 08/15/29	750	0	0	750 USD	92.58%	694'321.50	0.04	a)
US03027XAY67	3.7000 % AMT 3.7 10/15/49	350	0	0	350 USD	73.33%	256'653.60	0.02	a)
US03027XBB55	1.3000 % AMT 1.3 09/15/25	250	0	0	250 USD	94.02%	235'050.50	0.01	a)
US03027XBC39	2.1000 % AMT 2.1 06/15/30	500	0	0	500 USD	82.33%	411'653.00	0.03	a)
US03027XBD12	3.1000 % AMT 3.1 06/15/50	300	0	0	300 USD	65.12%	195'351.30	0.01	a)
US03027XBK54	2.9500 % AMT 2.95 01/15/51	750	0	0	750 USD	63.55%	476'628.00	0.03	a)
US03027XBL38	1.6000 % AMT 1.6 04/15/26	500	0	0	500 USD	92.74%	463'722.00	0.03	a)
US03027XBM11	2.7000 % AMT 2.7 04/15/31	500	0	0	500 USD	83.94%	419'703.50	0.03	a)
US03027XBS80	2.3000 % AMT 2.3 09/15/31	300	0	0	300 USD	80.75%	242'247.00	0.02	a)
US03027XCF50	5.9000 % AMT 5.9 11/15/33	200	200	0	200 USD	102.54%	205'073.60	0.01	a)
US03040WAD74	6.5930 % AWK 6.593 10/15/37	100	0	0	100 USD	111.41%	111'413.10	0.01	a)
US03040WAL90	3.4000 % AWK 3.4 03/01/25	350	0	0	350 USD	98.00%	343'003.15	0.02	a)
US03040WAQ87	2.9500 % AWK 2.95 09/01/27	0	100	0	100 USD	93.49%	93'490.30	0.01	a)
US03040WAR60	3.7500 % AWK 3 3/4 09/01/47	500	0	0	500 USD	77.91%	389'540.00	0.02	a)
US03040WAS44	3.7500 % AWK 3 3/4 09/01/28	0	200	0	200 USD	95.14%	190'286.60	0.01	a)
US03040WAT27	4.2000 % AWK 4.2 09/01/48	500	0	0	500 USD	83.84%	419'204.50	0.03	a)
US03040WAV72	4.1500 % AWK 4.15 06/01/49	500	0	0	500 USD	82.32%	411'607.00	0.03	a)
US03040WAW55	2.8000 % AWK 2.8 05/01/30	0	200	0	200 USD	87.73%	175'465.00	0.01	a)
US03040WAX39	3.4500 % AWK 3.45 05/01/50	500	0	0	500 USD	73.21%	366'035.50	0.02	a)
US03040WAZ86	3.2500 % AWK 3 1/4 06/01/51	0	200	0	200 USD	70.76%	141'515.60	0.01	a)
US03040WBA27	4.4500 % AWK 4.45 06/01/32	500	0	0	500 USD	95.64%	478'215.00	0.03	a)
US03073EAL92	3.4000 % COR 3.4 05/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03073EAM75	3.2500 % COR 3 1/4 03/01/25	500	0	0	500 USD	97.65%	488'238.00	0.03	a)
US03073EAN58	4.2500 % COR 4 1/4 03/01/45	0	140	0	140 USD	86.62%	121'265.48	0.01	a)
US03073EAQ89	4.3000 % COR 4.3 12/15/47	250	200	0	450 USD	84.92%	382'156.65	0.02	a)
US03073EAR62	2.8000 % COR 2.8 05/15/30	0	146	0	146 USD	87.91%	128'345.39	0.01	a)
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	0	300	0	300 USD	85.13%	255'377.70	0.02	a)
US03076CAG15	3.7000 % AMP 3.7 10/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03076CAH97	2.8750 % AMP 2 7/8 09/15/26	300	300	300	300 USD	94.98%	284'934.30	0.02	a)
US03076CAL00	4.5000 % AMP 4 1/2 05/13/32	150	150	150	150 USD	96.02%	144'028.95	0.01	a)
US031162BE93	4.9500 % AMGN 4.95 10/01/41	0	200	0	200 USD	92.74%	185'489.40	0.01	a)
US031162BK53	5.1500 % AMGN 5.15 11/15/41	0	250	0	250 USD	95.39%	238'474.25	0.01	a)
US031162BZ23	4.4000 % AMGN 4.4 05/01/45	0	790	0	790 USD	85.74%	677'376.02	0.04	a)
US031162CD02	4.5630 % AMGN 4.563 06/15/48	0	500	0	500 USD	86.08%	430'417.50	0.03	a)
US031162CF59	4.6630 % AMGN 4.663 06/15/51	0	1'075	0	1'075 USD	87.50%	940'598.13	0.06	a)
US031162CJ71	2.6000 % AMGN 2.6 08/19/26	0	500	0	500 USD	94.32%	471'588.50	0.03	a)
US031162CQ15	3.2000 % AMGN 3.2 11/02/27	0	300	0	300 USD	93.98%	281'926.50	0.02	a)
US031162CR97	3.1500 % AMGN 3.15 02/21/40	0	550	0	550 USD	74.91%	411'999.50	0.03	a)
US031162CS70	3.3750 % AMGN 3 3/8 02/21/50	0	750	0	750 USD	71.72%	537'900.00	0.03	a)
US031162CT53	2.2000 % AMGN 2.2 02/21/27	0	400	0	400 USD	92.24%	368'946.40	0.02	a)
US031162CU27	2.4500 % AMGN 2.45 02/21/30	0	400	0	400 USD	86.68%	346'711.20	0.02	a)
US031162CW82	2.3000 % AMGN 2.3 02/25/31	0	500	0	500 USD	83.28%	416'384.50	0.03	a)
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	0	400	0	400 USD	61.00%	243'984.00	0.02	a)
US031162CZ14	2.0000 % AMGN 2 01/15/32	0	300	0	300 USD	79.83%	239'493.90	0.01	a)
US031162DA53	2.8000 % AMGN 2.8 08/15/41	0	100	0	100 USD	71.26%	71'256.40	0.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US031162DB37	1.6500 % AMGN 1.65 08/15/28	0	300	0	300 USD	86.97%	260'904.60	0.02	a)
US031162DC10	3.0000 % AMGN 3 01/15/52	0	200	0	200 USD	66.28%	132'558.20	0.01	a)
US031162DD92	3.0000 % AMGN 3 02/22/29	0	250	0	250 USD	91.78%	229'455.75	0.01	a)
US031162DE75	3.3500 % AMGN 3.35 02/22/32	0	300	0	300 USD	87.93%	263'804.10	0.02	a)
US031162DF41	4.2000 % AMGN 4.2 02/22/52	0	600	0	600 USD	81.08%	486'450.00	0.03	a)
US031162DG24	4.4000 % AMGN 4.4 02/22/62	0	350	0	350 USD	80.22%	280'766.15	0.02	a)
US031162DH07	4.0500 % AMGN 4.05 08/18/29	0	400	0	400 USD	95.42%	381'665.20	0.02	a)
US031162DJ62	4.2000 % AMGN 4.2 03/01/33	0	200	0	200 USD	92.57%	185'139.80	0.01	a)
US031162DK36	4.8750 % AMGN 4 7/8 03/01/53	0	500	0	500 USD	90.18%	450'910.50	0.03	a)
US031162DM91	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/25	0	700	0	700 USD	99.76%	698'302.50	0.04	a)
US031162DN74	5.5070 % AMGN 5.507 03/02/26	0	600	0	600 USD	99.94%	599'624.40	0.04	a)
US031162DP23	5.1500 % AMGN 5.15 03/02/28	0	1'150	0	1'150 USD	100.08%	1'150'934.95	0.07	a)
US031162DQ06	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/30	0	850	0	850 USD	100.68%	855'753.65	0.05	a)
US031162DR88	5.2500 % AMGN 5 1/4 03/02/33	0	1'300	0	1'300 USD	99.86%	1'298'144.90	0.08	a)
US031162DS61	5.6000 % AMGN 5.6 03/02/43	0	1'000	0	1'000 USD	100.35%	1'003'502.00	0.06	a)
US031162DT45	5.6500 % AMGN 5.65 03/02/53	0	1'600	0	1'600 USD	100.80%	1'612'732.80	0.10	a)
US031162DU18	5.7500 % AMGN 5 3/4 03/02/63	0	850	0	850 USD	100.45%	853'862.40	0.05	a)
US032095AJ08	2.8000 % APH 2.8 02/15/30	500	0	0	500 USD	88.91%	444'553.00	0.03	a)
US032095AL53	2.2000 % APH 2.2 09/15/31	0	220	0	220 USD	81.70%	179'739.34	0.01	a)
US032654AN54	3.5000 % ADI 3 1/2 12/05/26	500	0	0	500 USD	96.55%	482'727.50	0.03	a)
US032654AU97	1.7000 % ADI 1.7 10/01/28	200	0	0	200 USD	87.30%	174'595.00	0.01	a)
US032654AV70	2.1000 % ADI 2.1 10/01/31	250	0	0	250 USD	83.01%	207'513.75	0.01	a)
US032654AW53	2.8000 % ADI 2.8 10/01/41	250	0	0	250 USD	70.83%	177'062.75	0.01	a)
US032654AX37	2.9500 % ADI 2.95 10/01/51	500	0	0	500 USD	66.64%	333'197.00	0.02	a)
US03512TAE10	3.7500 % ANGSI 3 3/4 10/01/30	200	0	0	200 USD	86.50%	173'000.00	0.01	a)
US03512TAF84	3.3750 % ANGSI 3 3/8 11/01/28	200	0	0	200 USD	89.50%	179'000.00	0.01	a)
US03522AAG58	3.6500 % ABIBB 3.65 02/01/26	500	0	0	500 USD	97.51%	487'572.00	0.03	a)
US03522AAH32	4.7000 % ABIBB 4.7 02/01/36	1'250	300	0	1'550 USD	95.69%	1'483'213.60	0.09	a)
US03522AAJ97	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	2'100	650	0	2'750 USD	93.50%	2'571'197.75	0.16	a)
US03523TBT43	4.4390 % ABIBB 4.439 10/06/48	632	0	0	632 USD	87.59%	553'541.62	0.03	a)
US03523TBU16	5.4500 % ABIBB 5.45 01/23/39	900	0	0	900 USD	101.74%	915'652.80	0.06	a)
US03523TBV98	5.5500 % ABIBB 5.55 01/23/49	900	0	0	900 USD	102.53%	922'754.70	0.06	a)
US03523TBW71	5.8000 % ABIBB 5.8 01/23/59	600	0	0	600 USD	106.05%	636'324.00	0.04	a)
US035240AL43	4.0000 % ABIBB 4 04/13/28	1'500	0	0	1'500 USD	96.99%	1'454'892.00	0.09	a)
US035240AM26	4.3750 % ABIBB 4 3/8 04/15/38	900	0	0	900 USD	91.47%	823'195.80	0.05	a)
US035240AN09	4.6000 % ABIBB 4.6 04/15/48	500	0	0	500 USD	89.76%	448'809.50	0.03	a)
US035240AP56	4.7500 % ABIBB 4 3/4 04/15/58	500	0	0	500 USD	90.35%	451'732.00	0.03	a)
US035240AQ30	4.7500 % ABIBB 4 3/4 01/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	99.32%	993'246.00	0.06	a)
US035240AR13	4.9000 % ABIBB 4.9 01/23/31	200	0	0	200 USD	100.57%	201'139.00	0.01	a)
US035240AS95	4.3500 % ABIBB 4.35 06/01/40	0	300	0	300 USD	89.64%	268'931.70	0.02	a)
US035240AT78	4.5000 % ABIBB 4 1/2 06/01/50	500	0	0	500 USD	90.16%	450'783.00	0.03	a)
US035240AV25	3.5000 % ABIBB 3 1/2 06/01/30	500	0	0	500 USD	92.40%	462'006.00	0.03	a)
US035242AN64	4.9000 % ABIBB 4.9 02/01/46	500	0	0	500 USD	92.51%	462'538.00	0.03	a)
US03524BAF31	4.6250 % ABIBB 4 5/8 02/01/44	550	0	0	550 USD	90.83%	499'583.15	0.03	a)
US036752AB92	3.6500 % ELV 3.65 12/01/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.62%	956'241.00	0.06	a)
US036752AD58	4.3750 % ELV 4 3/8 12/01/47	200	0	0	200 USD	84.98%	169'952.40	0.01	a)
US036752AG89	4.1010 % ELV 4.101 03/01/28	500	0	0	500 USD	96.63%	483'170.50	0.03	a)
US036752AH62	4.5500 % ELV 4.55 03/01/48	250	0	0	250 USD	87.32%	218'301.25	0.01	a)
US036752AJ29	2.3750 % ELV 2 3/8 01/15/25	400	0	0	400 USD	97.34%	389'340.00	0.02	a)
US036752AK91	3.7000 % ELV 3.7 09/15/49	500	0	0	500 USD	76.22%	381'123.50	0.02	a)
US036752AL74	2.8750 % ELV 2 7/8 09/15/29	500	0	0	500 USD	89.65%	448'256.50	0.03	a)
US036752AP88	2.5500 % ELV 2.55 03/15/31	0	250	0	250 USD	84.41%	211'030.00	0.01	a)
US036752AS28	3.6000 % ELV 3.6 03/15/51	0	300	0	300 USD	74.54%	223'628.70	0.01	a)
US036752AU73	4.5500 % ELV 4.55 05/15/52	500	0	0	500 USD	87.35%	436'772.50	0.03	a)
US036752AW30	5.5000 % ELV 5 1/2 10/15/32	300	0	0	300 USD	101.71%	305'121.00	0.02	a)
US036752AX13	6.1000 % ELV 6.1 10/15/52	300	100	0	400 USD	107.84%	431'353.20	0.03	a)
US037389AK90	8.2050 % AON 8.205 01/01/27	300	0	0	300 USD	107.30%	321'912.60	0.02	a)
US037389BC65	3.7500 % AON 3 3/4 05/02/29	0	200	0	200 USD	93.93%	187'852.80	0.01	a)
US037389BE22	2.8000 % AON 2.8 05/15/30	500	0	0	500 USD	86.70%	433'485.50	0.03	a)
US03740LAB80	2.9000 % AON 2.9 08/23/51	0	100	0	100 USD	62.43%	62'425.70	0.00	a)
US03740LAD47	2.8500 % AON 2.85 05/28/27	0	150	0	150 USD	93.27%	139'900.20	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US03740LAE20	3.9000 % AON 3.9 02/28/52	500	0	0	500 USD	74.88%	374'392.50	0.02	a)
US03740LAF94	5.0000 % AON 5 09/12/32	0	150	0	150 USD	97.32%	145'983.75	0.01	a)
US03740LAG77	5.3500 % AON 5.35 02/28/33	0	200	0	200 USD	99.54%	199'080.40	0.01	a)
US037411AW56	5.1000 % APA 5.1 09/01/40	0	400	0	400 USD	83.60%	334'400.00	0.02	a)
US037411BF15	4.2500 % APA 4 1/4 01/15/30	0	170	0	170 USD	91.63%	155'762.50	0.01	a)
US03769MAA45	6.3750 % APO 6 3/8 11/15/33	0	200	0	200 USD	107.07%	214'139.00	0.01	a)
US037735CM71	7.0000 % AEP 7 04/01/38	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037735CZ84	2.7000 % AEP 2.7 04/01/31 AA	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AL42	3.8500 % AAPL 3.85 05/04/43	920	0	0	920 USD	84.99%	781'900.64	0.05	a)
US037833AS94	3.4500 % AAPL 3.45 05/06/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833AT77	4.4500 % AAPL 4.45 05/06/44	250	0	0	250 USD	93.45%	233'637.00	0.01	a)
US037833AZ38	2.5000 % AAPL 2 1/2 02/09/25	450	0	0	450 USD	97.41%	438'360.30	0.03	a)
US037833BA77	3.4500 % AAPL 3.45 02/09/45	400	0	0	400 USD	78.81%	315'226.00	0.02	a)
US037833BG48	3.2000 % AAPL 3.2 05/13/25	750	0	0	750 USD	97.82%	733'686.75	0.05	a)
US037833BH21	4.3750 % AAPL 4 3/8 05/13/45	600	0	0	600 USD	91.12%	546'712.20	0.03	a)
US037833BW97	4.5000 % AAPL 4 1/2 02/23/36	550	230	0	780 USD	98.26%	766'406.16	0.05	a)
US037833BX70	4.6500 % AAPL 4.65 02/23/46	1'300	0	0	1'300 USD	93.99%	1'221'914.20	0.08	a)
US037833BY53	3.2500 % AAPL 3 1/4 02/23/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.94%	969'414.00	0.06	a)
US037833BZ29	2.4500 % AAPL 2.45 08/04/26	700	0	0	700 USD	94.71%	662'936.40	0.04	a)
US037833CD08	3.8500 % AAPL 3.85 08/04/46	500	0	0	500 USD	83.70%	418'499.00	0.03	a)
US037833CG39	3.0000 % AAPL 3 02/09/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833CH12	4.2500 % AAPL 4 1/4 02/09/47	500	0	0	500 USD	89.33%	446'674.00	0.03	a)
US037833CJ77	3.3500 % AAPL 3.35 02/09/27	700	0	0	700 USD	96.27%	673'873.90	0.04	a)
US037833CR93	3.2000 % AAPL 3.2 05/11/27	500	0	0	500 USD	95.55%	477'765.00	0.03	a)
US037833CU23	2.8500 % AAPL 2.85 05/11/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833CX61	3.0000 % AAPL 3 06/20/27	250	0	0	250 USD	94.69%	236'728.00	0.01	a)
US037833DB33	2.9000 % AAPL 2.9 09/12/27	600	0	0	600 USD	94.17%	565'009.20	0.04	a)
US037833DF47	2.7500 % AAPL 2 3/4 01/13/25	500	0	0	500 USD	97.99%	489'935.00	0.03	a)
US037833DG20	3.7500 % AAPL 3 3/4 11/13/47	500	0	0	500 USD	81.34%	406'690.50	0.03	a)
US037833DK32	3.0000 % AAPL 3 11/13/27	400	0	0	400 USD	94.53%	378'122.40	0.02	a)
US037833DN70	2.0500 % AAPL 2.05 09/11/26	500	0	0	500 USD	93.56%	467'791.00	0.03	a)
US037833DP29	2.2000 % AAPL 2.2 09/11/29	500	0	0	500 USD	88.13%	440'669.00	0.03	a)
US037833DQ02	2.9500 % AAPL 2.95 09/11/49	500	0	0	500 USD	69.70%	348'490.50	0.02	a)
US037833DT41	1.1250 % AAPL 1 1/8 05/11/25	500	0	0	500 USD	95.45%	477'228.00	0.03	a)
US037833DU14	1.6500 % AAPL 1.65 05/11/30	500	0	0	500 USD	83.36%	416'823.50	0.03	a)
US037833DV96	0.7500 % AAPL 0 3/4 05/11/23	6	0	6	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US037833DW79	2.6500 % AAPL 2.65 05/11/50	500	0	0	500 USD	64.77%	323'853.50	0.02	a)
US037833DX52	0.5500 % AAPL 0.55 08/20/25	2'000	0	0	2'000 USD	93.86%	1'877'178.00	0.12	a)
US037833DY36	1.2500 % AAPL 1 1/4 08/20/30	500	0	0	500 USD	80.91%	404'525.50	0.03	a)
US037833DZ01	2.4000 % AAPL 2.4 08/20/50	500	0	0	500 USD	61.78%	308'922.00	0.02	a)
US037833EA41	2.5500 % AAPL 2.55 08/20/60	500	0	0	500 USD	60.90%	304'511.50	0.02	a)
US037833EB24	0.7000 % AAPL 0.7 02/08/26	500	0	0	500 USD	92.24%	461'214.50	0.03	a)
US037833EC07	1.2000 % AAPL 1.2 02/08/28	500	400	0	900 USD	87.67%	789'041.70	0.05	a)
US037833ED89	1.6500 % AAPL 1.65 02/08/31	1'000	0	0	1'000 USD	82.26%	822'589.00	0.05	a)
US037833EF38	2.6500 % AAPL 2.65 02/08/51	600	0	0	600 USD	63.92%	383'503.20	0.02	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	1'500	0	0	1'500 USD	62.97%	944'590.50	0.06	a)
US037833EH93	1.4000 % AAPL 1.4 08/05/28	600	0	0	600 USD	87.18%	523'065.00	0.03	a)
US037833EJ59	1.7000 % AAPL 1.7 08/05/31	500	0	0	500 USD	81.16%	405'819.50	0.03	a)
US037833EQ92	3.9500 % AAPL 3.95 08/08/52	0	300	0	300 USD	83.35%	250'035.60	0.02	a)
US037833ES58	4.4210 % AAPL 4.421 05/08/26	0	250	0	250 USD	99.57%	248'917.00	0.02	a)
US037833ET32	4.0000 % AAPL 4 05/10/28	0	300	0	300 USD	97.90%	293'696.10	0.02	a)
US037833EU05	4.1500 % AAPL 4.15 05/10/30	0	200	0	200 USD	97.94%	195'884.20	0.01	a)
US037833EV87	4.3000 % AAPL 4.3 05/10/33	0	250	0	250 USD	98.65%	246'618.50	0.02	a)
US037833EW60	4.8500 % AAPL 4.85 05/10/53	0	519	0	519 USD	97.67%	506'881.87	0.03	a)
US038222AJ43	3.9000 % AMAT 3.9 10/01/25	250	0	0	250 USD	98.28%	245'691.50	0.02	a)
US038222AL98	3.3000 % AMAT 3.3 04/01/27	800	0	0	800 USD	95.82%	766'587.20	0.05	a)
US038222AM71	4.3500 % AMAT 4.35 04/01/47	550	0	0	550 USD	88.69%	487'809.30	0.03	a)
US038222AP03	2.7500 % AMAT 2 3/4 06/01/50	0	200	0	200 USD	67.28%	134'563.00	0.01	a)
US03835VAJ52	3.1000 % APTV 3.1 12/01/51	350	200	0	550 USD	62.67%	344'682.25	0.02	a)
US03836WAC73	4.2760 % WTRG 4.276 05/01/49	0	150	0	150 USD	80.77%	121'158.30	0.01	a)
US03938JAA79	5.1440 % ACGL 5.144 11/01/43	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US03938LBF04	6.8000 % MTNA 6.8 11/29/32	0	300	0	300 USD	105.34%	316'010.70	0.02	a)
US03939AAA51	3.6350 % ACGL 3.635 06/30/50	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US03939CAA18	4.0110 % ACGL 4.011 12/15/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US039482AB02	3.2500 % ADM 3 1/4 03/27/30	500	0	0	500 USD	90.25%	451'236.00	0.03	a)
US039482AD67	2.9000 % ADM 2.9 03/01/32	500	0	0	500 USD	85.28%	426'396.50	0.03	a)
US03990BAA98	6.3750 % ARES 6 3/8 11/10/28	0	200	0	200 USD	104.30%	208'607.40	0.01	a)
US04010LAX10	4.2000 % ARCC 4.2 06/10/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04010LAY92	3.2500 % ARCC 3 1/4 07/15/25	1'200	0	0	1'200 USD	95.89%	1'150'628.40	0.07	a)
US04010LBA08	2.1500 % ARCC 2.15 07/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	90.91%	909'149.00	0.06	a)
US04010LBF94	5.8750 % ARCC 5 7/8 03/01/29	0	300	0	300 USD	97.82%	293'463.90	0.02	a)
US04273WAC55	2.9500 % ARW 2.95 02/15/32	0	200	0	200 USD	83.41%	166'823.20	0.01	a)
US04273WAD39	6.1250 % ARW 6 1/8 03/01/26	0	200	0	200 USD	99.66%	199'323.20	0.01	a)
US04351LAB62	3.9450 % ASCHEA 3.945 11/15/46	500	0	0	500 USD	83.60%	417'997.50	0.03	a)
US04352EAA38	2.5320 % ASCHEA 2.532 11/15/29 B	500	0	0	500 USD	88.79%	443'943.50	0.03	a)
US046353AD01	6.4500 % AZN 6.45 09/15/37	870	0	0	870 USD	112.49%	978'626.46	0.06	a)
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	310	0	0	310 USD	85.02%	263'555.49	0.02	a)
US046353AL27	3.3750 % AZN 3 3/8 11/16/25	1'050	0	0	1'050 USD	97.25%	1'021'173.30	0.06	a)
US046353AM00	4.3750 % AZN 4 3/8 11/16/45	300	0	0	300 USD	88.59%	265'768.80	0.02	a)
US046353AN82	3.1250 % AZN 3 1/8 06/12/27	500	0	0	500 USD	95.00%	474'989.50	0.03	a)
US046353AT52	4.0000 % AZN 4 01/17/29	500	0	0	500 USD	96.32%	481'584.00	0.03	a)
US046353AU26	4.3750 % AZN 4 3/8 08/17/48	500	0	0	500 USD	88.65%	443'244.00	0.03	a)
US046353AV09	0.7000 % AZN 0.7 04/08/26	500	0	0	500 USD	91.43%	457'135.50	0.03	a)
US046353AX64	2.1250 % AZN 2 1/8 08/06/50	1'000	0	0	1'000 USD	58.71%	587'107.00	0.04	a)
US04650NAB01	5.3500 % T 5.35 09/01/40	0	200	0	200 USD	96.38%	192'756.40	0.01	a)
US049560AL95	4.1500 % ATO 4.15 01/15/43	0	200	0	200 USD	85.83%	171'660.60	0.01	a)
US049560AN51	3.0000 % ATO 3 06/15/27	0	100	0	100 USD	94.00%	94'003.80	0.01	a)
US049560AW50	2.8500 % ATO 2.85 02/15/52	0	500	0	500 USD	64.07%	320'365.50	0.02	a)
US05253JAL52	3.7000 % ANZ 3.7 11/16/25 MTN	250	0	0	250 USD	97.79%	244'482.50	0.02	a)
US05253JAX90	5.3750 % ANZ 5 3/8 07/03/25	0	300	0	300 USD	100.24%	300'727.50	0.02	a)
US05253JAY73	5.6710 % ANZ 5.671 10/03/25	0	300	0	300 USD	100.91%	302'723.70	0.02	a)
US05253JAZ49	4.7500 % ANZ 4 3/4 01/18/27 0000	0	350	0	350 USD	99.44%	348'046.30	0.02	a)
US05254JAA88	5.0880 % ANZ 5.088 12/08/25	0	350	0	350 USD	100.03%	350'100.80	0.02	a)
US052769AE63	3.5000 % ADSK 3 1/2 06/15/27	750	0	0	750 USD	95.59%	716'895.00	0.04	a)
US052769AH94	2.4000 % ADSK 2.4 12/15/31	0	200	0	200 USD	82.95%	165'908.40	0.01	a)
US053015AE30	3.3750 % ADP 3 3/8 09/15/25	500	0	0	500 USD	97.67%	488'359.50	0.03	a)
US053015AG87	1.7000 % ADP 1.7 05/15/28	400	0	0	400 USD	89.13%	356'526.00	0.02	a)
US05329RAA14	3.8500 % AN 3.85 03/01/32	0	200	0	200 USD	87.13%	174'250.40	0.01	a)
US05329WAQ50	4.7500 % AN 4 3/4 06/01/30	0	150	0	150 USD	94.76%	142'137.45	0.01	a)
US053332AV43	3.7500 % AZO 3 3/4 06/01/27	0	300	0	300 USD	96.05%	288'138.60	0.02	a)
US053332AZ56	4.0000 % AZO 4 04/15/30	0	230	0	230 USD	94.38%	217'067.10	0.01	a)
US053332BA96	1.6500 % AZO 1.65 01/15/31	0	190	0	190 USD	79.54%	151'124.48	0.01	a)
US053332BB79	4.7500 % AZO 4 3/4 08/01/32	0	230	0	230 USD	95.81%	220'354.72	0.01	a)
US053332BD36	4.7500 % AZO 4 3/4 02/01/33	0	170	0	170 USD	95.77%	162'806.45	0.01	a)
US053332BG66	6.2500 % AZO 6 1/4 11/01/28	0	160	0	160 USD	103.86%	166'183.84	0.01	a)
US053332BH40	6.5500 % AZO 6.55 11/01/33	0	160	0	160 USD	107.77%	172'433.12	0.01	a)
US053484AB76	2.0500 % AVB 2.05 01/15/32	500	0	0	500 USD	81.63%	408'166.00	0.03	a)
US05351WAA18	3.1500 % AGR 3.15 12/01/24	250	0	0	250 USD	98.22%	245'545.00	0.02	a)
US05351WAB90	3.8000 % AGR 3.8 06/01/29	500	0	0	500 USD	93.09%	465'458.50	0.03	a)
US05351WAC73	3.2000 % AGR 3.2 04/15/25	500	0	0	500 USD	97.15%	485'760.00	0.03	a)
US053611AJ82	4.8750 % AVY 4 7/8 12/06/28	300	0	0	300 USD	98.82%	296'447.40	0.02	a)
US053611AK55	2.6500 % AVY 2.65 04/30/30	300	0	0	300 USD	86.81%	260'431.20	0.02	a)
US053611AM12	2.2500 % AVY 2 1/4 02/15/32	300	0	0	300 USD	80.88%	242'630.10	0.02	a)
US053807AS28	4.6250 % AVT 4 5/8 04/15/26	600	0	0	600 USD	97.67%	585'997.20	0.04	a)
US054536AA57	8.6000 % AXASA 8.6 12/15/30	400	0	0	400 USD	118.26%	473'042.80	0.03	a)
US054561AJ49	4.3500 % EQH 4.35 04/20/28	500	0	0	500 USD	96.30%	481'479.50	0.03	a)
US054561AM77	5.0000 % EQH 5 04/20/48	500	200	0	700 USD	90.98%	636'829.20	0.04	a)
US055451AR98	4.1250 % BHP 4 1/8 02/24/42	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US055451AV01	5.0000 % BHP 5 09/30/43	820	0	820	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05565QDH83	3.7230 % BPLN 3.723 11/28/28	550	0	0	550 USD	94.91%	522'000.60	0.03	a)
US05578DAG79	4.0000 % BPCEGP 4 04/15/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05578DAX03	3.3750 % BPCEGP 3 3/8 12/02/26 MTN	250	0	0	250 USD	96.01%	240'024.50	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US056752AG38	4.1250 % BIDU 4 1/8 06/30/25	200	0	0	200 USD	98.19%	196'375.60	0.01	a)
US056752AJ76	3.6250 % BIDU 3 5/8 07/06/27	200	0	0	200 USD	95.44%	190'881.20	0.01	a)
US056752AM06	4.3750 % BIDU 4 3/8 05/14/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US056752AU22	2.3750 % BIDU 2 3/8 08/23/31	0	300	0	300 USD	82.57%	247'702.50	0.02	a)
US057224AZ09	5.1250 % BHI 5 1/8 09/15/40	600	0	0	600 USD	96.78%	580'674.00	0.04	a)
US05723KAE01	3.3370 % BHI 3.337 12/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	94.16%	941'647.00	0.06	a)
US059165EH95	3.5000 % EXC 3 1/2 08/15/46	500	0	0	500 USD	73.66%	368'318.00	0.02	a)
US059165EP12	4.5500 % EXC 4.55 06/01/52	200	0	0	200 USD	87.04%	174'071.40	0.01	a)
US059165EQ94	5.4000 % EXC 5.4 06/01/53	0	200	0	200 USD	98.53%	197'068.00	0.01	a)
US059438AH41	7.6250 % JPM 7 5/8 10/15/26	250	0	0	250 USD	106.27%	265'669.25	0.02	a)
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	600	0	0	600 USD	93.50%	560'974.20	0.04	a)
US05946KAN19	7.8830 % BBVASM 7.883 11/15/34	0	400	0	400 USD	106.66%	426'626.40	0.03	a)
US05964HAB15	4.2500 % SANTAN 4 1/4 04/11/27	200	0	0	200 USD	96.51%	193'013.80	0.01	a)
US05964HAF29	3.8000 % SANTAN 3.8 02/23/28	400	0	0	400 USD	94.00%	376'008.00	0.02	a)
US05964HAJ41	4.3790 % SANTAN 4.379 04/12/28	600	0	0	600 USD	96.05%	576'323.40	0.04	a)
US05964HAL96	1.8490 % SANTAN 1.849 03/25/26	600	0	0	600 USD	92.91%	557'431.20	0.03	a)
US05964HAM79	2.9580 % SANTAN 2.958 03/25/31	600	0	0	600 USD	85.22%	511'291.80	0.03	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	200	0	0	200 USD	90.39%	180'778.00	0.01	a)
US05964HAQ83	4.1750 % SANTAN 4.175 03/24/28	400	0	0	400 USD	95.74%	382'978.80	0.02	a)
US05964HAR66	5.1470 % SANTAN 5.147 08/18/25	600	0	0	600 USD	99.14%	594'826.80	0.04	a)
US05964HAS40	5.2940 % SANTAN 5.294 08/18/27	600	0	0	600 USD	99.24%	595'432.20	0.04	a)
US05964HAU95	5.5880 % SANTAN 5.588 08/08/28	0	400	0	400 USD	100.47%	401'891.60	0.03	a)
US05964HAX35	6.5270 % SANTAN 6.527 11/07/27	0	400	0	400 USD	102.18%	408'734.80	0.03	a)
US05964HAY18	6.6070 % SANTAN 6.607 11/07/28	0	400	0	400 USD	105.15%	420'617.20	0.03	a)
US05964HAZ82	6.9380 % SANTAN 6.938 11/07/33	0	400	0	400 USD	108.89%	435'570.40	0.03	a)
US05968LAM46	3.0000 % BCOLO 3 01/29/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05971KAA79	5.1790 % SANTAN 5.179 11/19/25	400	0	0	400 USD	98.79%	395'177.20	0.02	a)
US05971KAD19	2.7060 % SANTAN 2.706 06/27/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US05971KAE91	2.7460 % SANTAN 2.746 05/28/25	200	0	0	200 USD	96.49%	192'976.60	0.01	a)
US05971KAF66	3.4900 % SANTAN 3.49 05/28/30	0	400	0	400 USD	89.70%	358'814.80	0.02	a)
US05971KAL35	3.2250 % SANTAN 3.225 11/22/32	400	0	0	400 USD	82.38%	329'521.20	0.02	a)
US06050TJZ66	6.0000 % BAC 6 10/15/36 BKNT	250	250	0	500 USD	104.48%	522'394.00	0.03	a)
US06051GEN51	5.8750 % BAC 5 7/8 02/07/42 MTN	600	0	0	600 USD	106.29%	637'724.40	0.04	a)
US06051GFB05	4.1250 % BAC 4 1/8 01/22/24 MTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GFC87	5.0000 % BAC 5 01/21/44 MTN	350	0	0	350 USD	95.77%	335'188.70	0.02	a)
US06051GFF19	4.0000 % BAC 4 04/01/24 MTN	2'950	0	2'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GFG91	4.8750 % BAC 4 7/8 04/01/44 MTN	100	0	0	100 USD	94.33%	94'331.40	0.01	a)
US06051GFL86	4.2500 % BAC 4 1/4 10/22/26 MTN	850	0	0	850 USD	97.86%	831'780.25	0.05	a)
US06051GFM69	4.0000 % BAC 4 01/22/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	98.61%	986'080.00	0.06	a)
US06051GFP90	3.9500 % BAC 3.95 04/21/25 L	500	0	0	500 USD	98.32%	491'621.00	0.03	a)
US06051GFQ73	4.7500 % BAC 4 3/4 04/21/45 L	0	400	0	400 USD	91.11%	364'456.80	0.02	a)
US06051GFS30	3.8750 % BAC 3 7/8 08/01/25 MTN	1'050	0	0	1'050 USD	98.19%	1'031'040.15	0.06	a)
US06051GFU85	4.4500 % BAC 4.45 03/03/26 MTN	550	0	0	550 USD	98.36%	540'983.85	0.03	a)
US06051GFX25	3.5000 % BAC 3 1/2 04/19/26 GMTN	1'100	0	0	1'100 USD	97.08%	1'067'892.10	0.07	a)
US06051GGA13	3.2480 % BAC 3.248 10/21/27 MTN	550	0	0	550 USD	93.98%	516'896.60	0.03	a)
US06051GGC78	4.1830 % BAC 4.183 11/25/27 L	500	0	0	500 USD	96.43%	482'161.50	0.03	a)
US06051GGF00	3.8240 % BAC 3.824 01/20/28 MTN	500	0	0	500 USD	95.89%	479'451.50	0.03	a)
US06051GGG82	4.4430 % BAC 4.443 01/20/48 MTN	500	0	0	500 USD	86.14%	430'692.00	0.03	a)
US06051GGL77	3.7050 % BAC 3.705 04/24/28	0	500	0	500 USD	95.38%	476'923.50	0.03	a)
US06051GGM50	4.2440 % BAC 4.244 04/24/38	400	200	0	600 USD	88.35%	530'116.20	0.03	a)
US06051GGR48	3.5930 % BAC 3.593 07/21/28 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	94.42%	1'416'298.50	0.09	a)
US06051GGT04	3.0930 % BAC 3.093 10/01/25 MTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GGZ63	3.3660 % BAC 3.366 01/23/26	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHA04	3.9460 % BAC 3.946 01/23/49	0	360	0	360 USD	80.83%	290'974.68	0.02	a)
US06051GHD43	3.4190 % BAC 3.419 12/20/28	2'000	0	0	2'000 USD	93.58%	1'871'560.00	0.12	a)
US06051GHG73	3.9700 % BAC 3.97 03/05/29 MTN	500	0	0	500 USD	95.13%	475'629.00	0.03	a)
US06051GHM42	4.2710 % BAC 4.271 07/23/29 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	96.31%	963'131.00	0.06	a)
US06051GHQ55	3.9740 % BAC 3.974 02/07/30 MTN	500	0	0	500 USD	94.21%	471'041.00	0.03	a)
US06051GHR39	3.4580 % BAC 3.458 03/15/25 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHS12	4.3300 % BAC 4.33 03/15/50 MTN	500	250	0	750 USD	85.16%	638'684.25	0.04	a)
US06051GHT94	3.5590 % BAC 3.559 04/23/27 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	95.78%	957'752.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US06051GHU67	4.0780 % BAC 4.078 04/23/40 MTN	0	500	0	500 USD	85.05%	425'236.00	0.03	a)
US06051GHW41	3.1940 % BAC 3.194 07/23/30 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	89.70%	897'030.00	0.06	a)
US06051GHW24	2.4560 % BAC 2.456 10/22/25 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GHZ54	2.4960 % BAC 2.496 02/13/31 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	85.22%	852'169.00	0.05	a)
US06051GJA85	4.0830 % BAC 4.083 03/20/51 MTN	2'000	0	0	2'000 USD	80.24%	1'604'846.00	0.10	a)
US06051GJB68	2.5920 % BAC 2.592 04/29/31	1'750	0	0	1'750 USD	85.46%	1'495'621.75	0.09	a)
US06051GJD25	1.3190 % BAC 1.319 06/19/26 MTN	300	0	0	300 USD	94.67%	284'007.90	0.02	a)
US06051GJE08	2.6760 % BAC 2.676 06/19/41 MTN	1'300	0	0	1'300 USD	69.48%	903'238.70	0.06	a)
US06051GJF72	1.8980 % BAC 1.898 07/23/31 MTN	0	801	0	801 USD	81.11%	649'686.29	0.04	a)
US06051GJG55	0.9810 % BAC 0.981 09/25/25 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJK67	1.1970 % BAC 1.197 10/24/26 MTN	800	0	0	800 USD	93.16%	745'317.60	0.05	a)
US06051GJL41	1.9220 % BAC 1.922 10/24/31 MTN	250	0	0	250 USD	80.24%	200'595.25	0.01	a)
US06051GJM24	2.8310 % BAC 2.831 10/24/51 MTN	500	0	0	500 USD	64.11%	320'550.50	0.02	a)
US06051GJN07	3.4830 % BAC 3.483 03/13/52 N	500	0	0	500 USD	73.65%	368'271.00	0.02	a)
US06051GJP54	2.6510 % BAC 2.651 03/11/32 N	1'000	0	0	1'000 USD	83.71%	837'114.00	0.05	a)
US06051GJQ38	1.6580 % BAC 1.658 03/11/27 N	500	0	0	500 USD	92.23%	461'140.00	0.03	a)
US06051GJR11	0.9760 % BAC 0.976 04/22/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GJS93	1.7340 % BAC 1.734 07/22/27	1'500	420	0	1'920 USD	91.69%	1'760'444.16	0.11	a)
US06051GJT76	2.6870 % BAC 2.687 04/22/32	1'300	0	0	1'300 USD	83.11%	1'080'456.00	0.07	a)
US06051GJW06	3.3110 % BAC 3.311 04/22/42	800	0	0	800 USD	76.42%	611'341.60	0.04	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	87.88%	878'826.00	0.05	a)
US06051GKA66	2.2990 % BAC 2.299 07/21/32	1'000	0	0	1'000 USD	81.13%	811'281.00	0.05	a)
US06051GKB40	2.9720 % BAC 2.972 07/21/52	1'000	0	0	1'000 USD	66.61%	666'108.00	0.04	a)
US06051GKC23	2.4820 % BAC 2.482 09/21/36	500	0	0	500 USD	79.16%	395'793.50	0.02	a)
US06051GKD06	2.5720 % BAC 2.572 10/20/32	1'000	0	0	1'000 USD	82.23%	822'297.00	0.05	a)
US06051GKE88	1.5300 % BAC 1.53 12/06/25 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06051GKJ75	2.5510 % BAC 2.551 02/04/28 MTN	600	0	0	600 USD	92.56%	555'366.00	0.03	a)
US06051GKK49	2.9720 % BAC 2.972 02/04/33 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	84.10%	840'959.00	0.05	a)
US06051GKL22	3.8460 % BAC 3.846 03/08/37	200	500	0	700 USD	87.55%	612'872.40	0.04	a)
US06051GKM05	3.3840 % BAC 3.384 04/02/26 MTN	500	500	0	1'000 USD	97.66%	976'593.00	0.06	a)
US06051GKP36	4.3760 % BAC 4.376 04/27/28	0	650	0	650 USD	97.30%	632'463.65	0.04	a)
US06051GKQ19	4.5710 % BAC 4.571 04/27/33	1'000	0	0	1'000 USD	94.37%	943'714.00	0.06	a)
US06051GKW86	4.9480 % BAC 4.948 07/22/28 MTN	500	400	0	900 USD	98.86%	889'760.70	0.06	a)
US06051GKY43	5.0150 % BAC 5.015 07/22/33 MTN	1'300	300	0	1'600 USD	97.36%	1'557'806.40	0.10	a)
US06051GLA57	4.8270 % BAC 4.827 07/22/26 MTN	700	0	0	700 USD	99.06%	693'451.50	0.04	a)
US06051GLC14	6.2040 % BAC 6.204 11/10/28	500	0	0	500 USD	103.21%	516'057.50	0.03	a)
US06051GLE79	5.0800 % BAC 5.08 01/20/27	600	200	0	800 USD	99.44%	795'499.20	0.05	a)
US06051GLG28	5.2020 % BAC 5.202 04/25/29	0	1'300	0	1'300 USD	99.56%	1'294'326.80	0.08	a)
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	0	1'660	0	1'660 USD	98.45%	1'634'331.42	0.10	a)
US06051GLS65	5.8190 % BAC 5.819 09/15/29	0	1'200	0	1'200 USD	101.70%	1'220'416.80	0.08	a)
US06051GLU12	5.8720 % BAC 5.872 09/15/34	0	1'250	0	1'250 USD	102.58%	1'282'248.75	0.08	a)
US06051GLV94	5.9330 % BAC 5.933 09/15/27	0	400	0	400 USD	101.43%	405'713.60	0.03	a)
US06051GMA49	5.4680 % BAC 5.468 01/23/35	0	1'350	0	1'350 USD	99.80%	1'347'297.30	0.08	a)
US06367TQW35	0.6250 % BMO 0 5/8 07/09/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	96.03%	960'271.00	0.06	a)
US06367WHH97	3.3000 % BMO 3.3 02/05/24 E	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06367WMQ32	2.5000 % BMO 2 1/2 06/28/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06368BGS16	3.8030 % BMO 3.803 12/15/32	500	0	0	500 USD	92.37%	461'837.00	0.03	a)
US06368D3S13	3.7000 % BMO 3.7 06/07/25 MTN	300	0	0	300 USD	97.98%	293'931.00	0.02	a)
US06368DH723	3.0880 % BMO 3.088 01/10/37	500	0	0	500 USD	81.08%	405'389.00	0.03	a)
US06368EDC30	0.9490 % BMO 0.949 01/22/27 MTN	500	0	0	500 USD	92.36%	461'809.00	0.03	a)
US06368FAC32	1.2500 % BMO 1 1/4 09/15/26 MTN	250	0	0	250 USD	90.99%	227'465.25	0.01	a)
US06368FAE97	1.5000 % BMO 1 1/2 01/10/25 MTN	400	0	0	400 USD	96.74%	386'976.00	0.02	a)
US06368FAG46	2.1500 % BMO 2.15 03/08/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06368FAJ84	2.6500 % BMO 2.65 03/08/27 MTN	250	0	0	250 USD	93.30%	233'258.75	0.01	a)
US06368LNT97	5.3000 % BMO 5.3 06/05/26	0	400	0	400 USD	100.18%	400'708.80	0.03	a)
US06368LWT96	5.9200 % BMO 5.92 09/25/25	0	350	0	350 USD	101.04%	353'648.05	0.02	a)
US06368LWU69	5.7170 % BMO 5.717 09/25/28	0	500	0	500 USD	102.42%	512'104.00	0.03	a)
US06406FAC77	2.8000 % BK 2.8 05/04/26 MTN	250	0	0	250 USD	95.44%	238'591.75	0.01	a)
US06406FAE34	2.4500 % BK 2.45 08/17/26 MTN	250	0	0	250 USD	94.08%	235'210.00	0.01	a)
US06406GAA94	3.0000 % BK 3 10/30/28 MTN	250	0	0	250 USD	91.76%	229'394.75	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US06406HCS67	3.6500 % BK 3.65 02/04/24 0012	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06406HDA41	3.0000 % BK 3 02/24/25 G	500	0	0	500 USD	97.88%	489'402.50	0.03 a)	
US06406RAB33	3.4420 % BK 3.442 02/07/28 MTN	250	0	0	250 USD	95.47%	238'673.50	0.01 a)	
US06406RAD98	3.2500 % BK 3 1/4 05/16/27 MTN	500	0	0	500 USD	95.08%	475'377.50	0.03 a)	
US06406RAF47	3.4000 % BK 3.4 01/29/28 MTN	250	0	0	250 USD	94.54%	236'362.00	0.01 a)	
US06406RAH03	3.8500 % BK 3.85 04/28/28 MTN	500	0	0	500 USD	96.51%	482'533.50	0.03 a)	
US06406RAL15	2.1000 % BK 2.1 10/24/24 MTN	500	0	0	500 USD	97.85%	489'245.00	0.03 a)	
US06406RAN70	1.6000 % BK 1.6 04/24/25 MTN	500	0	0	500 USD	96.00%	480'012.50	0.03 a)	
US06406RAQ02	0.7500 % BK 0 3/4 01/28/26 MTN	250	0	0	250 USD	92.28%	230'695.00	0.01 a)	
US06406RAR84	1.6500 % BK 1.65 01/28/31 MTN	250	0	0	250 USD	80.47%	201'165.25	0.01 a)	
US06406RAS67	0.5000 % BK 0 1/2 04/26/24 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06406RAW79	1.8000 % BK 1.8 07/28/31 MTN	250	0	0	250 USD	80.73%	201'817.25	0.01 a)	
US06406RBA41	2.0500 % BK 2.05 01/26/27 MTN	250	0	0	250 USD	92.05%	230'128.50	0.01 a)	
US06406RBH93	4.2890 % BK 4.289 06/13/33 MTN	0	200	0	200 USD	93.37%	186'749.20	0.01 a)	
US06406RBJ59	4.4140 % BK 4.414 07/24/26	300	0	0	300 USD	98.42%	295'251.00	0.02 a)	
US06406RBL06	5.8020 % BK 5.802 10/25/28 MTN	0	250	0	250 USD	102.30%	255'745.25	0.02 a)	
US06406RBM88	5.8340 % BK 5.834 10/25/33 MTN	500	0	0	500 USD	103.78%	518'886.00	0.03 a)	
US06406RBP10	4.7060 % BK 4.706 02/01/34	0	200	0	200 USD	95.80%	191'603.60	0.01 a)	
US06406RBQ92	4.9470 % BK 4.947 04/26/27	0	300	0	300 USD	99.06%	297'174.30	0.02 a)	
US06406RBR75	4.9670 % BK 4.967 04/26/34 J	0	290	0	290 USD	97.12%	281'644.81	0.02 a)	
US06406RBT32	6.3170 % BK 6.317 10/25/29 MTN	0	500	0	500 USD	104.68%	523'416.50	0.03 a)	
US06406RBU05	6.4740 % BK 6.474 10/25/34 MTN	0	500	0	500 USD	108.34%	541'724.00	0.03 a)	
US0641593U89	1.0500 % BNS 1.05 03/02/26	500	0	0	500 USD	92.22%	461'094.00	0.03 a)	
US0641594A17	1.3500 % BNS 1.35 06/24/26	500	0	0	500 USD	91.77%	458'848.50	0.03 a)	
US0641594B99	2.1500 % BNS 2.15 08/01/31	500	0	0	500 USD	81.60%	408'003.50	0.03 a)	
US0641596E11	0.6500 % BNS 0.65 07/31/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0641598K52	1.3000 % BNS 1.3 09/15/26	500	0	0	500 USD	90.95%	454'730.50	0.03 a)	
US0641598N91	3.6250 % BNS 3 5/8 10/27/2081 2	700	0	0	700 USD	78.07%	546'504.00	0.03 a)	
US064159MK98	3.4000 % BNS 3.4 02/11/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US064159TF31	2.2000 % BNS 2.2 02/03/25	500	0	0	500 USD	97.06%	485'298.50	0.03 a)	
US064159VL70	1.3000 % BNS 1.3 06/11/25	500	0	0	500 USD	95.00%	474'978.50	0.03 a)	
US06417XAE13	2.4500 % BNS 2.45 02/02/32	500	0	0	500 USD	82.06%	410'275.50	0.03 a)	
US06417XAG60	4.5880 % BNS 4.588 05/04/37	0	1'000	0	1'000 USD	89.10%	890'973.00	0.06 a)	
US06417XAH44	3.4500 % BNS 3.45 04/11/25 MTN	500	0	0	500 USD	97.95%	489'772.50	0.03 a)	
US06417XAL55	5.2500 % BNS 5 1/4 12/06/24	400	0	0	400 USD	99.83%	399'312.00	0.02 a)	
US06418BAE83	2.9510 % BNS 2.951 03/11/27	500	0	0	500 USD	94.09%	470'471.00	0.03 a)	
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	0	900	0	900 USD	100.81%	907'309.80	0.06 a)	
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	0	550	0	550 USD	100.76%	554'169.55	0.03 a)	
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	650	0	0	650 USD	97.87%	636'173.20	0.04 a)	
US06738EAJ47	5.2500 % BACR 5 1/4 08/17/45	550	200	0	750 USD	95.43%	715'715.25	0.04 a)	
US06738EAN58	4.3750 % BACR 4 3/8 01/12/26	500	0	0	500 USD	97.77%	488'849.00	0.03 a)	
US06738EAP07	5.2000 % BACR 5.2 05/12/26	1'000	0	0	1'000 USD	98.81%	988'061.00	0.06 a)	
US06738EAU91	4.3370 % BACR 4.337 01/10/28	500	0	0	500 USD	96.08%	480'398.50	0.03 a)	
US06738EAV74	4.9500 % BACR 4.95 01/10/47	550	200	0	750 USD	90.96%	682'173.00	0.04 a)	
US06738EAW57	4.8360 % BACR 4.836 05/09/28	600	0	0	600 USD	96.25%	577'519.20	0.04 a)	
US06738EBD67	4.9720 % BACR 4.972 05/16/29	1'000	0	0	1'000 USD	97.31%	973'078.00	0.06 a)	
US06738EBH71	3.9320 % BACR 3.932 05/07/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EBK01	5.0880 % BACR 5.088 06/20/30	1'000	0	0	1'000 USD	94.73%	947'254.00	0.06 a)	
US06738EBL83	2.8520 % BACR 2.852 05/07/26	600	0	0	600 USD	96.66%	579'985.20	0.04 a)	
US06738EBM66	2.6450 % BACR 2.645 06/24/31	500	0	0	500 USD	82.93%	414'643.00	0.03 a)	
US06738EBS37	3.8110 % BACR 3.811 03/10/42	500	0	0	500 USD	74.73%	373'642.00	0.02 a)	
US06738EBU82	2.2790 % BACR 2.279 11/24/27	0	250	0	250 USD	90.86%	227'159.75	0.01 a)	
US06738EBV65	2.8940 % BACR 2.894 11/24/32	400	250	0	650 USD	81.00%	526'480.50	0.03 a)	
US06738EBW49	3.3300 % BACR 3.33 11/24/42	0	400	0	400 USD	72.23%	288'930.80	0.02 a)	
US06738EBY05	5.5010 % BACR 5.501 08/09/28	0	400	0	400 USD	99.35%	397'412.00	0.02 a)	
US06738ECA10	5.7460 % BACR 5.746 08/09/33	0	250	0	250 USD	98.72%	246'805.75	0.02 a)	
US06738ECC75	7.3250 % BACR 7.325 11/02/26	0	250	0	250 USD	102.57%	256'418.00	0.02 a)	
US06738ECD58	7.3850 % BACR 7.385 11/02/28	0	250	0	250 USD	105.69%	264'223.75	0.02 a)	
US06738ECE32	7.4370 % BACR 7.437 11/02/33	1'000	0	0	1'000 USD	109.04%	1'090'447.00	0.07 a)	
US06738ECF07	5.8290 % BACR 5.829 05/09/27	0	550	0	550 USD	100.10%	550'567.60	0.03 a)	
US06738ECG89	6.2240 % BACR 6.224 05/09/34	0	250	0	250 USD	101.41%	253'515.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US06738ECK91	6.4900 % BACR 6.49 09/13/29	0	350	0	350 USD	103.07%	360'761.80	0.02	a)
US06738ECL74	6.6920 % BACR 6.692 09/13/34	0	600	0	600 USD	104.54%	627'254.40	0.04	a)
US06849RAG74	5.7000 % ABXCN 5.7 05/30/41	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06849RAK86	5.7500 % ABXCN 5 3/4 05/01/43	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US07177MAB90	4.0000 % TACHEM 4 06/23/25	500	0	0	500 USD	98.15%	490'732.00	0.03	a)
US07177MAN39	5.2500 % TACHEM 5 1/4 06/23/45	0	200	0	200 USD	96.38%	192'753.00	0.01	a)
US071813BQ15	2.6000 % BAX 2.6 08/15/26	250	0	0	250 USD	93.57%	233'936.75	0.01	a)
US071813CH07	1.3220 % BAX 1.322 11/29/24	250	0	0	250 USD	96.85%	242'112.50	0.02	a)
US071813CL19	1.9150 % BAX 1.915 02/01/27	500	0	0	500 USD	90.96%	454'776.00	0.03	a)
US071813CP23	2.2720 % BAX 2.272 12/01/28	200	160	0	360 USD	87.64%	315'521.28	0.02	a)
US071813CS61	2.5390 % BAX 2.539 02/01/32	500	0	0	500 USD	81.94%	409'686.00	0.03	a)
US071813CV90	3.1320 % BAX 3.132 12/01/51	500	0	0	500 USD	65.02%	325'118.50	0.02	a)
US07274NBF96	4.4000 % BAYNGR 4.4 07/15/44 144A	400	0	0	400 USD	75.05%	300'194.80	0.02	a)
US07274NBH52	4.7000 % BAYNGR 4.7 07/15/64 144A	400	0	0	400 USD	71.70%	286'789.60	0.02	a)
US075887BF51	3.7340 % BDX 3.734 12/15/24	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887BG35	4.6850 % BDX 4.685 12/15/44	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CJ64	2.8230 % BDX 2.823 05/20/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US075887CL11	1.9570 % BDX 1.957 02/11/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0778FPAA77	4.4640 % BCECN 4.464 04/01/48	300	0	0	300 USD	85.07%	255'205.80	0.02	a)
US0778FPAB50	4.3000 % BCECN 4.3 07/29/49	0	300	0	300 USD	82.32%	246'966.30	0.02	a)
US0778FPAC34	0.7500 % BCECN 0 3/4 03/17/24 US3	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US0778FPAF64	3.6500 % BCECN 3.65 03/17/51 US4	0	200	0	200 USD	73.32%	146'633.40	0.01	a)
US0778FPAG48	2.1500 % BCECN 2.15 02/15/32 US5	300	0	0	300 USD	80.29%	240'869.40	0.02	a)
US0778FPAH21	3.2000 % BCECN 3.2 02/15/52 US6	0	400	0	400 USD	67.05%	268'203.60	0.02	a)
US0778FPAJ86	3.6500 % BCECN 3.65 08/15/52	500	200	0	700 USD	73.07%	511'485.80	0.03	a)
US0778FPAL33	5.1000 % BCECN 5.1 05/11/33	0	550	0	550 USD	98.61%	542'331.90	0.03	a)
US081437AT26	2.6300 % AMCR 2.63 06/19/30	0	125	0	125 USD	85.30%	106'619.00	0.01	a)
US08576PAH47	1.5700 % BERY 1.57 01/15/26	500	0	0	500 USD	92.88%	464'375.00	0.03	a)
US08576PAK75	5.5000 % BERY 5 1/2 04/15/28 144A	0	140	0	140 USD	99.25%	138'950.00	0.01	a)
US08652BAA70	4.4500 % BBY 4.45 10/01/28	400	0	0	400 USD	97.72%	390'891.20	0.02	a)
US090572AQ17	3.7000 % BIO 3.7 03/15/32	0	200	0	200 USD	88.68%	177'359.00	0.01	a)
US09062XAD57	5.2000 % BIIB 5.2 09/15/45	650	0	0	650 USD	93.75%	609'355.50	0.04	a)
US09062XAF06	4.0500 % BIIB 4.05 09/15/25	650	0	0	650 USD	97.91%	636'401.35	0.04	a)
US09062XAH61	2.2500 % BIIB 2 1/4 05/01/30	500	0	0	500 USD	83.32%	416'594.50	0.03	a)
US09062XAK90	3.2500 % BIIB 3 1/4 02/15/51	500	0	0	500 USD	68.01%	340'034.50	0.02	a)
US09247XAL55	3.5000 % BLK 3 1/2 03/18/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09247XAP69	3.2500 % BLK 3 1/4 04/30/29	500	0	0	500 USD	93.53%	467'644.50	0.03	a)
US09247XAQ43	2.4000 % BLK 2.4 04/30/30	500	0	0	500 USD	87.14%	435'680.00	0.03	a)
US09247XAR26	1.9000 % BLK 1.9 01/28/31	500	0	0	500 USD	82.58%	412'877.00	0.03	a)
US09261HAD98	2.6250 % BCRED 2 5/8 12/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09261HAR84	4.0000 % BCRED 4 01/15/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09261HAT41	4.7000 % BCRED 4.7 03/24/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09261HBB24	7.3000 % BCRED 7.3 11/27/28 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US09261LAC28	3.6250 % BXL 3 5/8 01/15/26	500	0	0	500 USD	95.21%	476'060.50	0.03	a)
US09261XAD49	2.1250 % BXL 2 1/8 02/15/27	500	0	0	500 USD	89.29%	446'456.00	0.03	a)
US09951LAC72	5.9500 % BAH 5.95 08/04/33	0	250	0	250 USD	103.00%	257'500.00	0.02	a)
US099724AH99	4.3750 % BWA 4 3/8 03/15/45	0	140	0	140 USD	81.29%	113'809.92	0.01	a)
US099724AJ55	3.3750 % BWA 3 3/8 03/15/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US099724AL02	2.6500 % BWA 2.65 07/01/27	300	0	0	300 USD	92.13%	276'391.80	0.02	a)
US10112RAW43	3.8000 % BXP 3.8 02/01/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US10112RAX26	3.6500 % BXP 3.65 02/01/26	500	0	0	500 USD	96.04%	480'184.00	0.03	a)
US10112RAY09	2.7500 % BXP 2 3/4 10/01/26	500	0	0	500 USD	92.57%	462'856.50	0.03	a)
US10112RAZ73	3.2000 % BXP 3.2 01/15/25	444	0	0	444 USD	97.84%	434'400.72	0.03	a)
US10112RBA14	4.5000 % BXP 4 1/2 12/01/28	500	0	0	500 USD	94.44%	472'193.00	0.03	a)
US10112RBB96	3.4000 % BXP 3.4 06/21/29	500	0	0	500 USD	88.14%	440'680.00	0.03	a)
US10112RBD52	3.2500 % BXP 3 1/4 01/30/31	0	400	0	400 USD	84.39%	337'579.60	0.02	a)
US10112RBF01	2.4500 % BXP 2.45 10/01/33	500	0	0	500 USD	74.14%	370'686.50	0.02	a)
US10112RBH66	6.5000 % BXP 6 1/2 01/15/34	0	250	0	250 USD	102.22%	255'541.25	0.02	a)
US101137BA41	2.6500 % BSX 2.65 06/01/30	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US10373QAB68	3.7960 % BPLN 3.796 09/21/25	750	0	0	750 USD	98.11%	735'812.25	0.05	a)
US10373QAC42	3.9370 % BPLN 3.937 09/21/28	500	200	0	700 USD	95.98%	671'841.80	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 USD	in % 7)	Kat.
US10373QAV23	3.0170 % BPLN 3.017 01/16/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.10%	950'971.00	0.06	a)
US10373QBE98	3.4100 % BPLN 3.41 02/11/26	0	200	0	200 USD	96.95%	193'909.60	0.01	a)
US10373QBG47	3.0000 % BPLN 3 02/24/50	500	200	0	700 USD	96.90%	468'303.50	0.03	a)
US10373QBK58	3.5430 % BPLN 3.543 04/06/27	0	250	0	250 USD	96.04%	240'110.00	0.01	a)
US10373QBL32	3.6330 % BPLN 3.633 04/06/30	1'000	0	0	1'000 USD	93.16%	931'587.00	0.06	a)
US10373QBN97	2.7720 % BPLN 2.772 11/10/50	0	250	0	250 USD	63.37%	158'415.50	0.01	a)
US10373QBP46	2.9390 % BPLN 2.939 06/04/51	500	0	0	500 USD	65.15%	325'744.00	0.02	a)
US10373QBQ29	3.3790 % BPLN 3.379 02/08/61	750	150	0	900 USD	67.68%	609'082.20	0.04	a)
US10373QBR02	3.0600 % BPLN 3.06 06/17/41	250	0	0	250 USD	73.99%	184'977.00	0.01	a)
US10373QBS84	3.0010 % BPLN 3.001 03/17/52	800	0	0	800 USD	65.88%	527'077.60	0.03	a)
US10373QBT67	2.7210 % BPLN 2.721 01/12/32	500	0	0	500 USD	84.72%	423'623.50	0.03	a)
US10373QBU31	4.8120 % BPLN 4.812 02/13/33	0	700	0	700 USD	97.43%	681'996.70	0.04	a)
US10373QBV14	4.8930 % BPLN 4.893 09/11/33	0	550	0	550 USD	97.88%	538'337.25	0.03	a)
US10373QBW96	4.9890 % BPLN 4.989 04/10/34	0	300	0	300 USD	98.05%	294'156.30	0.02	a)
US10373QBX79	4.6990 % BPLN 4.699 04/10/29	0	350	0	350 USD	98.76%	345'668.75	0.02	a)
US10922NAC74	3.7000 % BHF 3.7 06/22/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US10922NAF06	4.7000 % BHF 4.7 06/22/47	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122AU20	3.2500 % BMY 3 1/4 08/01/42	100	0	0	100 USD	75.50%	75'497.30	0.00	a)
US110122BB30	3.2500 % BMY 3 1/4 02/27/27	500	0	0	500 USD	95.96%	479'811.50	0.03	a)
US110122CM85	2.9000 % BMY 2.9 07/26/24	656	0	656	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122CN68	3.2000 % BMY 3.2 06/15/26	1'150	0	0	1'150 USD	96.11%	1'105'233.95	0.07	a)
US110122CP17	3.4000 % BMY 3.4 07/26/29	1'000	0	0	1'000 USD	93.00%	930'024.00	0.06	a)
US110122CR72	4.2500 % BMY 4 1/4 10/26/49	1'000	200	0	1'200 USD	84.12%	1'009'425.60	0.06	a)
US110122DE50	3.9000 % BMY 3.9 02/20/28	500	0	0	500 USD	96.74%	483'679.50	0.03	a)
US110122DH81	4.6250 % BMY 4 5/8 05/15/44	400	0	0	400 USD	89.33%	357'311.20	0.02	a)
US110122DJ48	5.0000 % BMY 5 08/15/45	500	0	0	500 USD	95.11%	475'540.00	0.03	a)
US110122DK11	4.3500 % BMY 4.35 11/15/47	500	0	0	500 USD	85.33%	426'633.50	0.03	a)
US110122DL93	4.5500 % BMY 4.55 02/20/48	500	0	0	500 USD	88.39%	441'969.50	0.03	a)
US110122DP08	1.1250 % BMY 1 1/8 11/13/27	500	0	0	500 USD	87.61%	438'073.50	0.03	a)
US110122DS47	2.5500 % BMY 2.55 11/13/50	500	0	0	500 USD	60.49%	302'425.00	0.02	a)
US110122DW58	3.7000 % BMY 3.7 03/15/52	0	500	0	500 USD	75.58%	377'897.00	0.02	a)
US110122DX32	3.9000 % BMY 3.9 03/15/62	0	350	0	350 USD	74.59%	261'076.55	0.02	a)
US110122DY15	5.7500 % BMY 5 3/4 02/01/31	0	500	0	500 USD	103.93%	519'661.50	0.03	a)
US110122DZ89	5.9000 % BMY 5.9 11/15/33	0	500	0	500 USD	106.00%	530'006.50	0.03	a)
US110122EB03	6.2500 % BMY 6 1/4 11/15/53	0	400	0	400 USD	111.31%	445'233.60	0.03	a)
US110122EC85	6.4000 % BMY 6.4 11/15/63	0	400	0	400 USD	112.14%	448'574.80	0.03	a)
US111021AE12	9.6250 % BRITEL 9 5/8 12/15/30	920	400	0	1'320 USD	122.30%	1'614'391.68	0.10	a)
US111021AL54	5.1250 % BRITEL 5 1/8 12/04/28	200	200	0	400 USD	100.36%	401'447.60	0.03	a)
US11120VAC72	4.1250 % BRX 4 1/8 06/15/26	200	0	0	200 USD	96.45%	192'901.40	0.01	a)
US11120VAF04	3.6500 % BRX 3.65 06/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US11120VAJ26	4.0500 % BRX 4.05 07/01/30	500	0	0	500 USD	91.98%	459'893.50	0.03	a)
US11133TAC71	3.4000 % BR 3.4 06/27/26	200	0	0	200 USD	95.66%	191'324.60	0.01	a)
US11133TAD54	2.9000 % BR 2.9 12/01/29	0	200	0	200 USD	88.41%	176'816.80	0.01	a)
US11133TAE38	2.6000 % BR 2.6 05/01/31	400	0	0	400 USD	83.20%	332'799.20	0.02	a)
US11134LAH24	3.8750 % AVGO 3 7/8 01/15/27	900	0	0	900 USD	96.74%	870'615.90	0.05	a)
US11134LAR06	3.5000 % AVGO 3 1/2 01/15/28	250	0	0	250 USD	94.07%	235'179.00	0.01	a)
US11135FAL58	4.1100 % AVGO 4.11 09/15/28	683	0	0	683 USD	95.67%	653'430.88	0.04	a)
US11135FAQ46	4.1500 % AVGO 4.15 11/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	93.54%	935'380.00	0.06	a)
US11135FAS02	4.3000 % AVGO 4.3 11/15/32	1'000	0	0	1'000 USD	92.53%	925'336.00	0.06	a)
US11135FBA84	4.7500 % AVGO 4 3/4 04/15/29	500	0	0	500 USD	98.09%	490'470.50	0.03	a)
US11135FBD24	5.0000 % AVGO 5 04/15/30	0	200	0	200 USD	99.72%	199'431.00	0.01	a)
US11135FBF71	2.6000 % AVGO 2.6 02/15/33 144A	0	100	0	100 USD	79.91%	79'908.00	0.00	a)
US11135FBG54	3.7500 % AVGO 3 3/4 02/15/51 144A	500	0	0	500 USD	74.26%	371'276.50	0.02	a)
US11135FBH38	2.4500 % AVGO 2.45 02/15/31 144A	500	300	0	800 USD	83.24%	665'897.60	0.04	a)
US11135FBJ93	3.5000 % AVGO 3 1/2 02/15/41 144A	500	0	0	500 USD	75.71%	378'529.00	0.02	a)
US11135FBK66	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 144A	0	100	0	100 USD	85.11%	85'112.30	0.01	a)
US11135FBQ37	3.1870 % AVGO 3.187 11/15/36 144A	0	200	0	200 USD	78.39%	156'778.60	0.01	a)
US11259NAA28	6.0870 % BNCN 6.087 06/14/33	0	200	0	200 USD	103.33%	206'664.00	0.01	a)
US11271LAB80	4.7000 % BNCN 4.7 09/20/47	0	410	0	410 USD	84.94%	348'269.99	0.02	a)
US11271LAC63	3.9000 % BNCN 3.9 01/25/28	0	300	0	300 USD	95.74%	287'211.00	0.02	a)
US11271LAD47	4.8500 % BNCN 4.85 03/29/29	0	500	0	500 USD	98.60%	492'985.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US11575TAC27	2.9240 % BROWNU 2.924 09/01/50 A	0	100	0	100 USD	69.71%	69'712.80	0.00	a)
US117043AT65	2.4000 % BC 2.4 08/18/31	0	200	0	200 USD	78.55%	157'093.80	0.01	a)
US120568AX84	3.2500 % BG 3 1/4 08/15/26	0	300	0	300 USD	95.26%	285'780.90	0.02	a)
US120568AZ33	3.7500 % BG 3 3/4 09/25/27	500	0	0	500 USD	95.60%	477'993.50	0.03	a)
US120568BB55	1.6300 % BG 1.63 08/17/25	500	0	0	500 USD	94.58%	472'924.00	0.03	a)
US120568BC39	2.7500 % BG 2 3/4 05/14/31	0	300	0	300 USD	85.19%	255'581.70	0.02	a)
US12189LAA98	5.7500 % BNSF 5 3/4 05/01/40	50	200	0	250 USD	104.47%	261'185.00	0.02	a)
US12189LAC54	5.0500 % BNSF 5.05 03/01/41	250	0	0	250 USD	96.85%	242'130.50	0.02	a)
US12189LAE11	5.4000 % BNSF 5.4 06/01/41	500	0	0	500 USD	100.30%	501'488.50	0.03	a)
US12189LAJ08	4.4000 % BNSF 4.4 03/15/42	100	0	0	100 USD	88.98%	88'981.90	0.01	a)
US12189LAK70	4.3750 % BNSF 4 3/8 09/01/42	400	0	0	400 USD	88.51%	354'029.20	0.02	a)
US12189LAN10	4.4500 % BNSF 4.45 03/15/43	800	0	0	800 USD	88.72%	709'764.80	0.04	a)
US12189LAP67	5.1500 % BNSF 5.15 09/01/43	250	0	0	250 USD	98.04%	245'093.25	0.02	a)
US12189LAV36	3.0000 % BNSF 3 04/01/25	300	0	0	300 USD	97.67%	293'013.00	0.02	a)
US12189LAW19	4.1500 % BNSF 4.15 04/01/45	250	0	0	250 USD	84.33%	210'827.50	0.01	a)
US12189LAX91	4.7000 % BNSF 4.7 09/01/45	500	0	0	500 USD	91.59%	457'970.50	0.03	a)
US12189LAZ40	3.9000 % BNSF 3.9 08/01/46	400	0	0	400 USD	80.46%	321'835.20	0.02	a)
US12189LBA89	3.2500 % BNSF 3 1/4 06/15/27	300	0	0	300 USD	95.50%	286'489.20	0.02	a)
US12189LBG59	3.3000 % BNSF 3.3 09/15/51	0	200	0	200 USD	71.61%	143'213.00	0.01	a)
US12189LBH33	2.8750 % BNSF 2 7/8 06/15/52	0	150	0	150 USD	65.39%	98'084.55	0.01	a)
US12189LBI98	4.4500 % BNSF 4.45 01/15/53	300	0	0	300 USD	88.16%	264'469.80	0.02	a)
US12189LBK61	5.2000 % BNSF 5.2 04/15/54	0	500	0	500 USD	98.09%	490'443.00	0.03	a)
US12189TAZ75	6.1500 % BNSF 6.15 05/01/37	250	0	0	250 USD	109.10%	272'757.25	0.02	a)
US124857AJ27	4.8500 % PARA 4.85 07/01/42	150	0	0	150 USD	72.03%	108'043.05	0.01	a)
US124857AK99	4.9000 % PARA 4.9 08/15/44	700	0	0	700 USD	70.49%	493'430.00	0.03	a)
US124857AN39	4.6000 % PARA 4.6 01/15/45	500	0	0	500 USD	67.45%	337'268.50	0.02	a)
US124857AQ69	4.0000 % PARA 4 01/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US124857AR43	2.9000 % PARA 2.9 01/15/27	250	150	118	282 USD	89.95%	253'654.49	0.02	a)
US12503MAA62	3.6500 % CBOE 3.65 01/12/27	0	240	0	240 USD	96.85%	232'438.56	0.01	a)
US12505BAD29	4.8750 % CBG 4 7/8 03/01/26	0	200	0	200 USD	98.91%	197'826.20	0.01	a)
US12505BAE02	2.5000 % CBG 2 1/2 04/01/31	200	0	0	200 USD	82.36%	164'726.00	0.01	a)
US12505BAG59	5.9500 % CBG 5.95 08/15/34	0	300	0	300 USD	100.97%	302'909.10	0.02	a)
US12513GBE89	4.1250 % CDW 4 1/8 05/01/25	500	0	0	500 USD	97.75%	488'750.00	0.03	a)
US12513GBG38	2.6700 % CDW 2.67 12/01/26	500	0	0	500 USD	92.82%	464'089.50	0.03	a)
US12513GBH11	3.2760 % CDW 3.276 12/01/28	400	0	0	400 USD	89.81%	359'252.40	0.02	a)
US12513GBJ76	3.5690 % CDW 3.569 12/01/31	0	300	0	300 USD	86.51%	259'521.00	0.02	a)
US12532HAC88	1.4500 % GIBACN 1.45 09/14/26	250	0	0	250 USD	90.12%	225'296.00	0.01	a)
US12541WAA80	4.2000 % CHRW 4.2 04/15/28	250	0	0	250 USD	96.63%	241'585.00	0.02	a)
US125491AN04	3.2000 % CIXCN 3.2 12/17/30	0	300	0	300 USD	79.02%	237'051.90	0.01	a)
US125491AP51	4.1000 % CIXCN 4.1 06/15/51	0	450	0	450 USD	58.28%	262'271.70	0.02	a)
US125523AG54	4.1250 % CI 4 1/8 11/15/25	500	0	0	500 USD	98.32%	491'591.00	0.03	a)
US125523AH38	4.3750 % CI 4 3/8 10/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	97.29%	972'919.00	0.06	a)
US125523AJ93	4.8000 % CI 4.8 08/15/38	0	600	0	600 USD	92.79%	556'734.60	0.03	a)
US125523AK66	4.9000 % CI 4.9 12/15/48	500	500	0	1'000 USD	88.56%	885'621.00	0.06	a)
US125523AV22	3.2500 % CI 3 1/4 04/15/25	500	0	0	500 USD	97.63%	488'144.00	0.03	a)
US125523AZ36	3.0500 % CI 3.05 10/15/27	400	0	0	400 USD	92.98%	371'924.00	0.02	a)
US125523BK57	3.8750 % CI 3 7/8 10/15/47	0	200	0	200 USD	76.63%	153'259.80	0.01	a)
US125523BX78	3.5000 % CI 3 1/2 06/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US125523CB40	3.4000 % CI 3.4 03/01/27	450	0	0	450 USD	95.29%	428'805.90	0.03	a)
US125523CF53	4.8000 % CI 4.8 07/15/46	1'000	0	0	1'000 USD	89.54%	895'403.00	0.06	a)
US125523CJ75	3.2000 % CI 3.2 03/15/40	0	200	0	200 USD	74.47%	148'940.20	0.01	a)
US125523CK49	3.4000 % CI 3.4 03/15/50	0	400	0	400 USD	70.06%	280'236.00	0.02	a)
US125523CL22	2.4000 % CI 2.4 03/15/30	500	0	0	500 USD	85.21%	426'031.50	0.03	a)
US125523CQ19	3.4000 % CI 3.4 03/15/51	500	350	0	850 USD	70.06%	595'542.30	0.04	a)
US125523CR91	5.6850 % CI 5.685 03/15/26	0	500	0	500 USD	99.84%	499'219.00	0.03	a)
US125523CS74	5.4000 % CI 5.4 03/15/33	0	600	0	600 USD	100.67%	604'002.60	0.04	a)
US12592BAJ35	4.2000 % CNHI 4.2 01/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12592BAL80	1.8750 % CNHI 1 7/8 01/15/26	500	0	0	500 USD	93.74%	468'716.50	0.03	a)
US12592BAQ77	4.5500 % CNHI 4.55 04/10/28	0	250	0	250 USD	97.88%	244'695.75	0.02	a)
US12592BAR50	5.5000 % CNHI 5 1/2 01/12/29	0	150	0	150 USD	100.93%	151'395.45	0.01	a)
US12594KAB89	3.8500 % CNHI 3.85 11/15/27 MTN	0	150	0	150 USD	95.99%	143'991.75	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US12621EAK91	5.2500 % CNO 5 1/4 05/30/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12625GAG91	3.3000 % CNOOC 3.3 09/30/49	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12634MAB63	3.5000 % CNOOC 3 1/2 05/05/25	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12634MAE03	4.3750 % CNOOC 4 3/8 05/02/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126408GK35	6.1500 % CSX 6.15 05/01/37	100	0	0	100 USD	107.65%	107'646.20	0.01	a)
US126408GS60	6.2200 % CSX 6.22 04/30/40	100	0	0	100 USD	108.62%	108'624.70	0.01	a)
US126408GW72	4.7500 % CSX 4 3/4 05/30/42	303	0	0	303 USD	92.48%	280'210.46	0.02	a)
US126408GY39	4.1000 % CSX 4.1 03/15/44	250	0	0	250 USD	84.12%	210'296.75	0.01	a)
US126408HB27	3.4000 % CSX 3.4 08/01/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126408HC00	3.9500 % CSX 3.95 05/01/50	250	0	0	250 USD	80.29%	200'717.00	0.01	a)
US126408HD82	3.3500 % CSX 3.35 11/01/25	500	0	0	500 USD	97.09%	485'456.00	0.03	a)
US126408HE65	2.6000 % CSX 2.6 11/01/26	500	0	0	500 USD	94.44%	472'221.00	0.03	a)
US126408HF31	3.8000 % CSX 3.8 11/01/46	500	0	0	500 USD	78.80%	394'001.50	0.02	a)
US126408HG14	4.2500 % CSX 4 1/4 11/01/66	500	0	0	500 USD	80.69%	403'427.50	0.03	a)
US126408HK26	4.3000 % CSX 4.3 03/01/48	1'000	0	0	1'000 USD	85.26%	852'571.00	0.05	a)
US126408HM81	4.2500 % CSX 4 1/4 03/15/29	700	0	0	700 USD	97.36%	681'535.40	0.04	a)
US126408HN64	4.7500 % CSX 4 3/4 11/15/48	300	0	0	300 USD	91.27%	273'820.50	0.02	a)
US126408HT35	2.5000 % CSX 2 1/2 05/15/51	0	100	0	100 USD	60.91%	60'913.50	0.00	a)
US126408HU08	4.1000 % CSX 4.1 11/15/32	0	250	0	250 USD	93.35%	233'375.50	0.01	a)
US126408HV80	4.5000 % CSX 4 1/2 11/15/52	500	0	0	500 USD	87.72%	438'623.50	0.03	a)
US126408HW63	5.2000 % CSX 5.2 11/15/33	0	200	0	200 USD	100.44%	200'881.40	0.01	a)
US126650CD09	5.3000 % CVS 5.3 12/05/43	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CF56	3.3750 % CVS 3 3/8 08/12/24	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CL25	3.8750 % CVS 3 7/8 07/20/25	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CM08	4.8750 % CVS 4 7/8 07/20/35	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CN80	5.1250 % CVS 5 1/8 07/20/45	950	0	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CU24	2.8750 % CVS 2 7/8 06/01/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CW89	4.1000 % CVS 4.1 03/25/25	361	0	361	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CX62	4.3000 % CVS 4.3 03/25/28	2'077	200	2'277	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CY46	4.7800 % CVS 4.78 03/25/38	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650CZ11	5.0500 % CVS 5.05 03/25/48	2'700	0	2'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DF48	3.0000 % CVS 3 08/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DG21	3.2500 % CVS 3 1/4 08/15/29	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DK33	4.1250 % CVS 4 1/8 04/01/40	0	290	290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DL16	4.2500 % CVS 4 1/4 04/01/50	0	220	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DN71	1.7500 % CVS 1 3/4 08/21/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DT42	5.1250 % CVS 5 1/8 02/21/30	0	430	430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DU15	5.2500 % CVS 5 1/4 02/21/33	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DW70	5.0000 % CVS 5 01/30/29	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DY37	5.3000 % CVS 5.3 06/01/33	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DZ02	5.8750 % CVS 5 7/8 06/01/53	0	350	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650EA42	6.0000 % CVS 6 06/01/63	0	220	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US133131AX02	3.1500 % CPT 3.15 07/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	91.05%	910'451.00	0.06	a)
US134429BF51	3.9500 % CPB 3.95 03/15/25	0	250	0	250 USD	98.39%	245'986.75	0.02	a)
US134429BG35	4.1500 % CPB 4.15 03/15/28	500	0	0	500 USD	96.66%	483'288.00	0.03	a)
US134429BH18	4.8000 % CPB 4.8 03/15/48	500	0	0	500 USD	87.58%	437'875.00	0.03	a)
US134429BJ73	2.3750 % CPB 2 3/8 04/24/30	0	100	0	100 USD	84.94%	84'938.00	0.01	a)
US134429BK47	3.1250 % CPB 3 1/8 04/24/50	0	100	0	100 USD	65.46%	65'459.50	0.00	a)
US13607GAP90	3.1000 % CM 3.1 04/02/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GLZ53	2.2500 % CM 2 1/4 01/28/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.28%	972'760.00	0.06	a)
US13607HR535	3.6000 % CM 3.6 04/07/32	500	0	0	500 USD	89.85%	449'242.00	0.03	a)
US13607HR618	3.4500 % CM 3.45 04/07/27	500	0	0	500 USD	95.28%	476'396.00	0.03	a)
US13607LWT69	5.9260 % CM 5.926 10/02/26	0	250	0	250 USD	101.67%	254'180.00	0.02	a)
US13607LWV16	5.9860 % CM 5.986 10/03/28	0	200	0	200 USD	103.40%	206'800.80	0.01	a)
US13607LWW98	6.0920 % CM 6.092 10/03/33	0	350	0	350 USD	103.62%	362'658.80	0.02	a)
US136375BL52	6.2500 % CNRCN 6 1/4 08/01/34	250	0	0	250 USD	108.81%	272'018.50	0.02	a)
US136375CV26	4.4500 % CNRCN 4.45 01/20/49	250	0	0	250 USD	89.57%	223'936.00	0.01	a)
US136375CZ30	2.4500 % CNRCN 2.45 05/01/50	250	0	0	250 USD	62.12%	155'311.50	0.01	a)
US136375DB52	4.4000 % CNRCN 4.4 08/05/52	200	0	0	200 USD	88.43%	176'856.80	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US136375DC36	3.8500 % CNRCN 3.85 08/05/32	300	0	0	300 USD	92.19%	276'581.40	0.02	a)
US136385AX99	3.8500 % CNQCN 3.85 06/01/27	400	0	0	400 USD	95.79%	383'176.80	0.02	a)
US136385BA87	2.9500 % CNQCN 2.95 07/15/30	300	0	0	300 USD	86.79%	260'383.50	0.02	a)
US13645RAS31	2.9000 % CP 2.9 02/01/25	250	0	0	250 USD	97.62%	244'048.75	0.02	a)
US13645RAU86	4.8000 % CP 4.8 08/01/45	0	100	0	100 USD	90.79%	90'786.90	0.01	a)
US13645RAX26	6.1250 % CP 6 1/8 09/15/2115	250	0	0	250 USD	105.02%	262'545.25	0.02	a)
US13645RAY09	4.0000 % CP 4 06/01/28	250	0	0	250 USD	96.15%	240'383.00	0.02	a)
US13645RBD52	1.3500 % CP 1.35 12/02/24	250	0	0	250 USD	96.92%	242'300.00	0.02	a)
US13645RBE36	1.7500 % CP 1 3/4 12/02/26	300	0	0	300 USD	91.60%	274'794.30	0.02	a)
US13645RBF01	2.4500 % CP 2.45 12/02/31	600	0	0	600 USD	90.31%	541'852.20	0.03	a)
US13645RBG83	3.0000 % CP 3 12/02/41	250	0	0	250 USD	85.39%	213'480.00	0.01	a)
US13645RBH66	3.1000 % CP 3.1 12/02/51	450	250	0	700 USD	67.86%	475'030.50	0.03	a)
US13648TAA51	2.0500 % CP 2.05 03/05/30	0	150	0	150 USD	84.10%	126'150.15	0.01	a)
US13648TAG22	3.5000 % CP 3 1/2 05/01/50	0	150	0	150 USD	73.28%	109'912.50	0.01	a)
US14040HBG92	3.2000 % COF 3.2 02/05/25	0	400	0	400 USD	97.76%	391'020.80	0.02	a)
US14040HBJ32	4.2000 % COF 4.2 10/29/25	0	250	0	250 USD	97.76%	244'391.25	0.02	a)
US14040HBK05	3.7500 % COF 3 3/4 07/28/26	0	290	0	290 USD	96.10%	278'696.09	0.02	a)
US14040HBW43	3.8000 % COF 3.8 01/31/28	0	525	0	525 USD	94.70%	497'159.25	0.03	a)
US14040HCM51	2.6360 % COF 2.636 03/03/26	0	500	0	500 USD	96.78%	483'888.50	0.03	a)
US14040HCN35	3.2730 % COF 3.273 03/01/30	0	350	0	350 USD	89.51%	313'275.90	0.02	a)
US14040HCS22	4.9270 % COF 4.927 05/10/28	0	800	0	800 USD	97.73%	781'822.40	0.05	a)
US14040HCT05	5.2680 % COF 5.268 05/10/33	0	400	0	400 USD	97.32%	389'264.40	0.02	a)
US14040HCU77	4.9850 % COF 4.985 07/24/26	0	500	0	500 USD	99.05%	495'235.00	0.03	a)
US14040HCV50	5.2470 % COF 5.247 07/26/30	0	300	0	300 USD	97.46%	292'372.50	0.02	a)
US14040HCX17	5.4680 % COF 5.468 02/01/29	0	500	0	500 USD	99.50%	497'487.50	0.03	a)
US14040HCY99	5.8170 % COF 5.817 02/01/34	0	400	0	400 USD	99.01%	396'036.40	0.02	a)
US14040HCZ64	6.3120 % COF 6.312 06/08/29	0	550	0	550 USD	102.55%	564'039.30	0.04	a)
US14040HDA05	6.3770 % COF 6.377 06/08/34	0	550	0	550 USD	102.77%	565'235.00	0.04	a)
US14040HDB87	7.1490 % COF 7.149 10/29/27	0	500	0	500 USD	103.19%	515'933.00	0.03	a)
US14040HDC60	7.6240 % COF 7.624 10/30/31	0	750	0	750 USD	109.45%	820'876.50	0.05	a)
US14149YBH09	3.0790 % CAH 3.079 06/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14149YBJ64	3.4100 % CAH 3.41 06/15/27	500	0	0	500 USD	94.74%	473'685.00	0.03	a)
US14149YBM93	4.3680 % CAH 4.368 06/15/47	0	260	0	260 USD	82.01%	213'217.16	0.01	a)
US142339AH37	3.7500 % CSL 3 3/4 12/01/27	300	0	0	300 USD	94.78%	284'349.30	0.02	a)
US142339AJ92	2.7500 % CSL 2 3/4 03/01/30	0	200	0	200 USD	86.69%	173'386.00	0.01	a)
US142339AL49	2.2000 % CSL 2.2 03/01/32	300	0	0	300 USD	78.92%	236'765.40	0.01	a)
US14448CAL81	2.7000 % CARR 2.7 02/15/31	500	0	0	500 USD	85.17%	425'837.00	0.03	a)
US14448CAN48	2.2420 % CARR 2.242 02/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.88%	968'759.00	0.06	a)
US14448CAQ78	2.7220 % CARR 2.722 02/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	87.57%	875'693.00	0.05	a)
US14448CAR51	3.3770 % CARR 3.377 04/05/40	0	300	0	300 USD	77.25%	231'736.80	0.01	a)
US14448CAS35	3.5770 % CARR 3.577 04/05/50	500	0	0	500 USD	73.40%	367'024.50	0.02	a)
US14448CAT18	5.8000 % CARR 5.8 11/30/25 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14448CAY03	5.9000 % CARR 5.9 03/15/34 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14448CBA18	6.2000 % CARR 6.2 03/15/54 144A	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14448CBB90	5.8000 % CARR 5.8 11/30/25	0	300	0	300 USD	100.72%	302'154.61	0.02	a)
US14448CBC73	5.9000 % CARR 5.9 03/15/34	0	300	0	300 USD	104.40%	313'207.11	0.02	a)
US14448CBD56	6.2000 % CARR 6.2 03/15/54	0	500	0	500 USD	109.02%	545'109.73	0.03	a)
US149123BS95	5.2000 % CAT 5.2 05/27/41	400	0	0	400 USD	100.44%	401'772.40	0.03	a)
US149123CB51	3.8030 % CAT 3.803 08/15/42	600	0	0	600 USD	83.23%	499'366.20	0.03	a)
US149123CC35	3.4000 % CAT 3.4 05/15/24	380	0	380	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US149123CD18	4.3000 % CAT 4.3 05/15/44	200	0	0	200 USD	90.11%	180'227.40	0.01	a)
US149123CE90	4.7500 % CAT 4 3/4 05/15/64	500	0	0	500 USD	90.11%	450'547.50	0.03	a)
US149123CH22	2.6000 % CAT 2.6 04/09/30	1'000	0	0	1'000 USD	88.72%	887'240.00	0.06	a)
US149123CJ87	3.2500 % CAT 3 1/4 04/09/50	500	0	0	500 USD	73.77%	368'829.50	0.02	a)
US149123CK50	1.9000 % CAT 1.9 03/12/31	250	0	0	250 USD	83.69%	209'237.00	0.01	a)
US14913QB33	2.1500 % CAT 2.15 11/08/24 MTN	500	0	0	500 USD	97.87%	489'325.00	0.03	a)
US14913R2G11	1.1000 % CAT 1.1 09/14/27 MTN	500	0	0	500 USD	88.08%	440'404.00	0.03	a)
US14913R2H93	0.8000 % CAT 0.8 11/13/25 MTN	500	0	0	500 USD	93.30%	466'492.00	0.03	a)
US14913R2J59	0.2500 % CAT 0 1/4 03/01/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US14913R2K23	0.9000 % CAT 0.9 03/02/26	600	0	0	600 USD	92.38%	554'287.80	0.03	a)
US15089QAL86	6.0500 % CE 6.05 03/15/25	0	300	218	82 USD	100.35%	82'290.36	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US15089QAM69	6.1650 % CE 6.165 07/15/27	0	580	0	580 USD	101.30%	587'517.96	0.04	a)
US15089QAN43	6.3300 % CE 6.33 07/15/29	0	200	0	200 USD	102.73%	205'452.60	0.01	a)
US15089QAP90	6.3790 % CE 6.379 07/15/32	0	300	0	300 USD	102.74%	308'214.00	0.02	a)
US15089QAR56	5.9000 % CE 5.9 07/05/24	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15089QAW42	6.3500 % CE 6.35 11/15/28	0	300	0	300 USD	102.83%	308'500.80	0.02	a)
US15089QAX25	6.5500 % CE 6.55 11/15/30	0	500	0	500 USD	103.79%	518'970.50	0.03	a)
US15089QAY08	6.7000 % CE 6.7 11/15/33	0	250	0	250 USD	104.99%	262'464.50	0.02	a)
US15135BAR24	4.2500 % CNC 4 1/4 12/15/27	0	750	0	750 USD	95.25%	714'375.00	0.04	a)
US15135BAT89	4.6250 % CNC 4 5/8 12/15/29	0	1'050	0	1'050 USD	94.70%	994'350.00	0.06	a)
US15135BAV36	3.3750 % CNC 3 3/8 02/15/30	0	450	0	450 USD	88.25%	397'125.00	0.02	a)
US15135BAW19	3.0000 % CNC 3 10/15/30	0	600	0	600 USD	85.25%	511'500.00	0.03	a)
US15135BAX91	2.5000 % CNC 2 1/2 03/01/31	0	500	0	500 USD	82.07%	410'359.00	0.03	a)
US15135BAY74	2.4500 % CNC 2.45 07/15/28	0	700	0	700 USD	88.13%	616'875.00	0.04	a)
US15135BAZ40	2.6250 % CNC 2 5/8 08/01/31	0	850	0	850 USD	81.88%	695'937.50	0.04	a)
US15135UAF66	6.7500 % CVECN 6 3/4 11/15/39	100	0	0	100 USD	107.54%	107'536.70	0.01	a)
US15135UAP49	5.2500 % CVECN 5 1/4 06/15/37	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US15135UAR05	5.4000 % CVECN 5.4 06/15/47	300	0	0	300 USD	92.24%	276'712.80	0.02	a)
US15135UAX72	3.7500 % CVECN 3 3/4 02/15/52	0	150	0	150 USD	71.39%	107'077.95	0.01	a)
US15189TBA43	1.4500 % CNP 1.45 06/01/26	0	100	0	100 USD	91.87%	91'873.00	0.01	a)
US15189TBB26	2.6500 % CNP 2.65 06/01/31	500	0	0	500 USD	84.04%	420'224.50	0.03	a)
US15189XAM02	3.5500 % CNP 3.55 08/01/42	500	0	0	500 USD	77.89%	389'461.50	0.02	a)
US15189XAY40	3.6000 % CNP 3.6 03/01/52 AH	500	0	0	500 USD	75.36%	376'817.00	0.02	a)
US15189XBB38	4.9500 % CNP 4.95 04/01/33	0	400	0	400 USD	98.62%	394'486.40	0.02	a)
US15189XBD93	5.2000 % CNP 5.2 10/01/28	0	200	0	200 USD	100.96%	201'915.00	0.01	a)
US15189YAF34	1.7500 % CNP 1 3/4 10/01/30	0	200	0	200 USD	81.17%	162'340.80	0.01	a)
US15189YAG17	5.2500 % CNP 5 1/4 03/01/28	0	250	0	250 USD	100.81%	252'034.00	0.02	a)
US15189YAH99	5.4000 % CNP 5.4 03/01/33	0	200	0	200 USD	100.98%	201'954.80	0.01	a)
US161175AY09	4.9080 % CHTR 4.908 07/23/25	0	500	0	500 USD	98.64%	493'178.50	0.03	a)
US161175AZ73	6.3840 % CHTR 6.384 10/23/35	0	115	0	115 USD	96.55%	111'030.55	0.01	a)
US161175BA14	6.4840 % CHTR 6.484 10/23/45	0	1'124	0	1'124 USD	91.39%	1'027'180.89	0.06	a)
US161175BJ23	3.7500 % CHTR 3 3/4 02/15/28	0	300	0	300 USD	92.21%	276'616.20	0.02	a)
US161175BK95	4.2000 % CHTR 4.2 03/15/28	0	400	0	400 USD	93.94%	375'776.40	0.02	a)
US161175BL78	5.3750 % CHTR 5 3/8 05/01/47	0	610	0	610 USD	78.74%	480'310.34	0.03	a)
US161175BM51	5.3750 % CHTR 5 3/8 04/01/38	0	490	0	490 USD	85.58%	419'354.25	0.03	a)
US161175BN35	5.7500 % CHTR 5 3/4 04/01/48	0	1'150	0	1'150 USD	83.08%	955'438.40	0.06	a)
US161175BT05	4.8000 % CHTR 4.8 03/01/50	0	850	0	850 USD	72.32%	614'760.80	0.04	a)
US161175BU77	2.8000 % CHTR 2.8 04/01/31	0	1'000	0	1'000 USD	80.65%	806'479.00	0.05	a)
US161175BY99	3.8500 % CHTR 3.85 04/01/61	0	300	0	300 USD	57.91%	173'730.60	0.01	a)
US161175BZ64	3.5000 % CHTR 3 1/2 06/01/41	0	450	0	450 USD	66.32%	298'433.25	0.02	a)
US161175CA05	3.9000 % CHTR 3.9 06/01/52	0	750	0	750 USD	62.87%	471'555.75	0.03	a)
US161175CD44	2.2500 % CHTR 2 1/4 01/15/29	0	400	0	400 USD	84.46%	337'851.20	0.02	a)
US161175CG74	3.9500 % CHTR 3.95 06/30/62	0	300	0	300 USD	59.04%	177'110.10	0.01	a)
US161175CJ14	4.4000 % CHTR 4.4 04/01/33	0	300	0	300 USD	87.38%	262'148.70	0.02	a)
US161175CK86	5.2500 % CHTR 5 1/4 04/01/53	0	650	0	650 USD	77.30%	502'475.35	0.03	a)
US161175CL69	5.5000 % CHTR 5 1/2 04/01/63	0	300	0	300 USD	76.94%	230'815.50	0.01	a)
US161175CM43	6.1500 % CHTR 6.15 11/10/26	0	500	0	500 USD	100.71%	503'529.00	0.03	a)
US161175CP73	6.6500 % CHTR 6.65 02/01/34	0	500	0	500 USD	100.06%	500'313.00	0.03	a)
US16411QAG64	4.5000 % CQP 4 1/2 10/01/29	500	0	0	500 USD	93.80%	469'000.00	0.03	a)
US16411QAK76	4.0000 % CQP 4 03/01/31	0	430	0	430 USD	89.22%	383'646.00	0.02	a)
US16411QAN16	3.2500 % CQP 3 1/4 01/31/32	600	0	0	600 USD	83.50%	501'000.00	0.03	a)
US16411QAP63	5.9500 % CQP 5.95 06/30/33 144A	0	400	0	400 USD	100.33%	401'320.00	0.03	a)
US16411RAK59	4.6250 % LNG 4 5/8 10/15/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16412XAC92	5.8750 % CHCOCH 5 7/8 03/31/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16412XAG07	5.1250 % CHCOCH 5 1/8 06/30/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US16412XAJ46	3.7000 % CHCOCH 3.7 11/15/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US166756AH97	2.3430 % CVX 2.343 08/12/50	1'000	0	0	1'000 USD	60.22%	602'182.00	0.04	a)
US166756AP14	3.9000 % CVX 3.9 11/15/24	300	0	0	300 USD	99.09%	297'264.00	0.02	a)
US166764BD17	3.3260 % CVX 3.326 11/17/25	250	0	0	250 USD	96.76%	241'910.50	0.02	a)
US166764BL33	2.9540 % CVX 2.954 05/16/26	500	0	0	500 USD	95.94%	479'700.00	0.03	a)
US166764BT68	2.8950 % CVX 2.895 03/03/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US166764BW97	1.5540 % CVX 1.554 05/11/25	500	0	0	500 USD	95.89%	479'436.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US166764BY53	2.2360 % CVX 2.236 05/11/30	500	0	0	500 USD	86.46%	432'323.50	0.03	a)
US171232AQ41	6.0000 % CB 6 05/11/37	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US171232AS07	6.5000 % CB 6 1/2 05/15/38 1	139	0	139	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US17136MAB81	5.0000 % CHD 5 06/15/52	200	100	0	300 USD	94.17%	282'508.80	0.02	a)
US17136MAC64	5.6000 % CHD 5.6 11/15/32	300	0	0	300 USD	103.65%	310'950.60	0.02	a)
US17252MAN02	3.7000 % CTAS 3.7 04/01/27	500	0	0	500 USD	97.03%	485'148.00	0.03	a)
US17252MAQ33	4.0000 % CTAS 4 05/01/32	0	230	0	230 USD	94.01%	216'222.31	0.01	a)
US17275RAD44	5.9000 % CSCO 5.9 02/15/39	680	0	0	680 USD	107.08%	728'157.60	0.05	a)
US17275RAF91	5.5000 % CSCO 5 1/2 01/15/40	525	0	0	525 USD	103.02%	540'844.50	0.03	a)
US17275RAW25	3.5000 % CSCO 3 1/2 06/15/25	150	0	0	150 USD	98.03%	147'042.30	0.01	a)
US17275RBC51	2.9500 % CSCO 2.95 02/28/26	450	0	0	450 USD	96.31%	433'372.95	0.03	a)
US17275RBL50	2.5000 % CSCO 2 1/2 09/20/26	500	0	0	500 USD	94.33%	471'626.50	0.03	a)
US172967BL44	6.6250 % C 6 5/8 06/15/32	250	0	0	250 USD	106.20%	265'511.00	0.02	a)
US172967CC36	6.0000 % C 6 10/31/33	250	0	0	250 USD	103.04%	257'608.25	0.02	a)
US172967DR95	6.1250 % C 6 1/8 08/25/36	553	0	0	553 USD	102.80%	568'465.75	0.04	a)
US172967EW71	8.1250 % C 8 1/8 07/15/39	300	200	0	500 USD	126.58%	632'885.50	0.04	a)
US172967FX46	5.8750 % C 5 7/8 01/30/42	270	0	0	270 USD	104.79%	282'925.98	0.02	a)
US172967HA25	6.6750 % C 6.675 09/13/43	600	0	0	600 USD	110.13%	660'804.00	0.04	a)
US172967HB08	5.5000 % C 5 1/2 09/13/25	400	0	0	400 USD	100.18%	400'734.80	0.03	a)
US172967HS33	5.3000 % C 5.3 05/06/44	250	0	0	250 USD	94.84%	237'108.00	0.01	a)
US172967HT16	3.7500 % C 3 3/4 06/16/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967JC62	4.3000 % C 4.3 11/20/26	750	0	0	750 USD	97.34%	730'081.50	0.05	a)
US172967JL61	3.8750 % C 3 7/8 03/26/25	500	0	0	500 USD	98.12%	490'599.50	0.03	a)
US172967JP75	3.3000 % C 3.3 04/27/25	750	0	0	750 USD	97.50%	731'246.25	0.05	a)
US172967JT97	4.4000 % C 4.4 06/10/25	2'650	0	1'200	1'450 USD	98.46%	1'427'630.85	0.09	a)
US172967KA87	4.4500 % C 4.45 09/29/27	1'050	400	0	1'450 USD	96.92%	1'405'335.65	0.09	a)
US172967KG57	3.7000 % C 3.7 01/12/26	1'000	0	0	1'000 USD	97.41%	974'080.00	0.06	a)
US172967KJ96	4.6000 % C 4.6 03/09/26	550	0	0	550 USD	98.15%	539'834.90	0.03	a)
US172967KN09	3.4000 % C 3.4 05/01/26	1'250	0	0	1'250 USD	96.26%	1'203'211.25	0.08	a)
US172967KR13	4.7500 % C 4 3/4 05/18/46	700	0	0	700 USD	87.67%	613'680.20	0.04	a)
US172967KU42	4.1250 % C 4 1/8 07/25/28	500	0	0	500 USD	95.27%	476'374.50	0.03	a)
US172967KY63	3.2000 % C 3.2 10/21/26	950	0	0	950 USD	94.95%	902'063.00	0.06	a)
US172967LD18	3.8870 % C 3.887 01/10/28	500	0	0	500 USD	95.60%	477'989.50	0.03	a)
US172967LJ87	4.2810 % C 4.281 04/24/48	0	300	0	300 USD	84.47%	253'396.50	0.02	a)
US172967LP48	3.6680 % C 3.668 07/24/28	500	200	0	700 USD	95.06%	665'453.60	0.04	a)
US172967LS86	3.5200 % C 3.52 10/27/28	500	0	0	500 USD	94.01%	470'035.00	0.03	a)
US172967LU33	3.8780 % C 3.878 01/24/39	0	400	0	400 USD	84.06%	336'246.40	0.02	a)
US172967LW98	4.0750 % C 4.075 04/23/29	800	0	0	800 USD	95.41%	763'316.00	0.05	a)
US172967MD09	4.6500 % C 4.65 07/23/48	500	200	0	700 USD	89.29%	625'044.70	0.04	a)
US172967ME81	3.9800 % C 3.98 03/20/30	500	200	0	700 USD	93.98%	657'839.70	0.04	a)
US172967MF56	3.3520 % C 3.352 04/24/25	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	500	0	0	500 USD	85.86%	429'299.00	0.03	a)
US172967MM08	5.3160 % C 5.316 03/26/41	500	0	0	500 USD	97.94%	489'694.50	0.03	a)
US172967MP39	4.4120 % C 4.412 03/31/31	2'000	0	0	2'000 USD	93.99%	1'879'766.00	0.12	a)
US172967MQ12	3.1060 % C 3.106 04/08/26	500	0	0	500 USD	97.13%	485'625.00	0.03	a)
US172967MS77	2.5720 % C 2.572 06/03/31	1'500	0	0	1'500 USD	84.15%	1'262'238.00	0.08	a)
US172967MX62	0.9810 % C 0.981 05/01/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967MY46	2.5610 % C 2.561 05/01/32	1'000	0	0	1'000 USD	82.29%	822'899.00	0.05	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	800	0	0	800 USD	91.26%	730'099.20	0.05	a)
US172967NE72	2.5200 % C 2.52 11/03/32	500	0	0	500 USD	81.33%	406'637.00	0.03	a)
US172967NF48	2.9040 % C 2.904 11/03/42	300	0	0	300 USD	71.10%	213'294.30	0.01	a)
US172967NG21	3.0700 % C 3.07 02/24/28 VAR	300	300	0	600 USD	93.82%	562'905.60	0.04	a)
US172967NL16	3.2900 % C 3.29 03/17/26	0	550	0	550 USD	97.65%	537'081.05	0.03	a)
US172967NN71	3.7850 % C 3.785 03/17/33	500	300	0	800 USD	88.10%	704'780.80	0.04	a)
US172967NS68	4.6580 % C 4.658 05/24/28	0	250	0	250 USD	98.30%	245'757.75	0.02	a)
US172967NU15	4.9100 % C 4.91 05/24/33	200	450	0	650 USD	95.78%	622'554.40	0.04	a)
US172967NX53	5.6100 % C 5.61 09/29/26	0	750	0	750 USD	100.11%	750'819.00	0.05	a)
US172967PA33	6.2700 % C 6.27 11/17/33	600	200	0	800 USD	104.91%	839'280.80	0.05	a)
US17308CC539	2.9760 % C 2.976 11/05/30	500	150	0	650 USD	88.11%	572'698.10	0.04	a)
US17325FBB31	5.8030 % C 5.803 09/29/28	0	750	0	750 USD	102.57%	769'284.00	0.05	a)
US17325FBC14	5.4880 % C 5.488 12/04/26 BKNT	0	500	0	500 USD	100.94%	504'678.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US17327CAM55	1.1220 % C 1.122 01/28/27	500	0	0	500 USD	91.99%	459'955.50	0.03	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	1'000	0	0	1'000 USD	83.80%	837'983.00	0.05	a)
US17327CAR43	6.1740 % C 6.174 05/25/34	0	1'000	0	1'000 USD	100.72%	1'007'206.00	0.06	a)
US174610AR61	2.8500 % CFG 2.85 07/27/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US174610AT28	3.2500 % CFG 3 1/4 04/30/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US189054AW99	3.9000 % CLX 3.9 05/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	95.97%	959'678.00	0.06	a)
US189054AX72	1.8000 % CLX 1.8 05/15/30	0	150	0	150 USD	82.46%	123'696.30	0.01	a)
US189054AY55	4.4000 % CLX 4.4 05/01/29	0	150	0	150 USD	97.29%	145'935.15	0.01	a)
US189054AZ21	4.6000 % CLX 4.6 05/01/32	0	200	0	200 USD	96.89%	193'786.00	0.01	a)
US191216CE82	2.9000 % KO 2.9 05/25/27	500	0	0	500 USD	94.85%	474'227.50	0.03	a)
US191216CM09	2.1250 % KO 2 1/8 09/06/29	700	0	0	700 USD	87.97%	615'760.60	0.04	a)
US191216CQ13	4.2000 % KO 4.2 03/25/50	500	0	0	500 USD	87.82%	439'098.00	0.03	a)
US191216CR95	3.3750 % KO 3 3/8 03/25/27	250	0	0	250 USD	96.40%	240'990.50	0.02	a)
US191216CV08	1.6500 % KO 1.65 06/01/30	1'500	0	0	1'500 USD	83.72%	1'255'743.00	0.08	a)
US191216CX63	2.6000 % KO 2.6 06/01/50	500	0	0	500 USD	64.56%	322'803.50	0.02	a)
US191216CY47	2.7500 % KO 2 3/4 06/01/60	250	0	0	250 USD	63.82%	159'555.25	0.01	a)
US191216DC18	2.5000 % KO 2 1/2 03/15/51	250	0	0	250 USD	62.60%	156'507.25	0.01	a)
US191216DE73	1.3750 % KO 1 3/8 03/15/31	1'000	0	0	1'000 USD	79.93%	799'324.00	0.05	a)
US191216DL17	3.0000 % KO 3 03/05/51	500	0	0	500 USD	70.29%	351'440.50	0.02	a)
US191216DP21	2.2500 % KO 2 1/4 01/05/32	500	0	0	500 USD	84.26%	421'297.00	0.03	a)
US191241AJ70	1.8500 % KOF 1.85 09/01/32	300	0	0	300 USD	77.85%	233'564.40	0.01	a)
US194162AN32	3.1000 % CL 3.1 08/15/27	200	0	0	200 USD	95.24%	190'480.40	0.01	a)
US194162AP89	3.2500 % CL 3 1/4 08/15/32	200	0	0	200 USD	89.62%	179'237.00	0.01	a)
US194162AQ62	4.8000 % CL 4.8 03/02/26	0	150	0	150 USD	100.10%	150'146.10	0.01	a)
US194162AR46	4.6000 % CL 4.6 03/01/28	0	150	0	150 USD	100.43%	150'637.80	0.01	a)
US194162AS29	4.6000 % CL 4.6 03/01/33	0	150	0	150 USD	99.11%	148'670.10	0.01	a)
US19416QEG10	3.2500 % CL 3 1/4 03/15/24 MTN	50	250	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US19416QEJ58	4.0000 % CL 4 08/15/45 MTN	300	0	0	300 USD	87.30%	261'900.90	0.02	a)
US198280AF63	4.5000 % CPGX 4 1/2 06/01/25	300	0	0	300 USD	98.54%	295'612.20	0.02	a)
US20030NAC56	7.0500 % CMCSA 7.05 03/15/33	250	0	0	250 USD	112.19%	280'465.50	0.02	a)
US20030NAF87	5.6500 % CMCSA 5.65 06/15/35	100	0	0	100 USD	102.61%	102'609.20	0.01	a)
US20030NAK72	6.5000 % CMCSA 6 1/2 11/15/35	150	0	0	150 USD	109.23%	163'847.40	0.01	a)
US20030NBE04	4.6500 % CMCSA 4.65 07/15/42	200	0	0	200 USD	89.83%	179'656.40	0.01	a)
US20030NBH35	4.2500 % CMCSA 4 1/4 01/15/33	960	750	0	1'710 USD	93.71%	1'602'519.66	0.10	a)
US20030NBL47	3.3750 % CMCSA 3 3/8 02/15/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NBM20	4.2000 % CMCSA 4.2 08/15/34	200	0	0	200 USD	92.01%	184'018.20	0.01	a)
US20030NBN03	3.3750 % CMCSA 3 3/8 08/15/25	400	0	0	400 USD	97.67%	390'671.60	0.02	a)
US20030NBP50	4.4000 % CMCSA 4.4 08/15/35	500	600	0	1'100 USD	92.65%	1'019'179.70	0.06	a)
US20030NBT72	3.2000 % CMCSA 3.2 07/15/36	300	0	0	300 USD	80.71%	242'126.10	0.02	a)
US20030NBU46	3.4000 % CMCSA 3.4 07/15/46	200	0	0	200 USD	73.02%	146'043.60	0.01	a)
US20030NBW02	2.3500 % CMCSA 2.35 01/15/27	400	0	0	400 USD	93.34%	373'362.80	0.02	a)
US20030NBY67	3.3000 % CMCSA 3.3 02/01/27	500	0	0	500 USD	95.84%	479'214.00	0.03	a)
US20030NBZ33	4.0000 % CMCSA 4 08/15/47	400	0	0	400 USD	79.90%	319'611.60	0.02	a)
US20030NCA72	3.1500 % CMCSA 3.15 02/15/28	500	0	0	500 USD	93.73%	468'655.00	0.03	a)
US20030NCC39	3.9690 % CMCSA 3.969 11/01/47	450	0	0	450 USD	78.97%	355'366.35	0.02	a)
US20030NCE94	3.9990 % CMCSA 3.999 11/01/49	1'400	0	0	1'400 USD	79.25%	1'109'455.20	0.07	a)
US20030NCG43	4.0490 % CMCSA 4.049 11/01/52	500	0	0	500 USD	79.08%	395'382.50	0.02	a)
US20030NCH26	3.5500 % CMCSA 3.55 05/01/28	500	0	0	500 USD	94.87%	474'351.50	0.03	a)
US20030NCJ81	3.9000 % CMCSA 3.9 03/01/38	300	0	0	300 USD	85.55%	256'647.90	0.02	a)
US20030NCK54	4.0000 % CMCSA 4 03/01/48	650	0	0	650 USD	79.65%	517'736.70	0.03	a)
US20030NCM11	4.7000 % CMCSA 4.7 10/15/48	300	0	0	300 USD	90.12%	270'358.80	0.02	a)
US20030NCN93	4.9500 % CMCSA 4.95 10/15/58	200	0	0	200 USD	91.80%	183'601.20	0.01	a)
US20030NCR08	3.7000 % CMCSA 3.7 04/15/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NCS80	3.9500 % CMCSA 3.95 10/15/25	600	0	0	600 USD	98.30%	589'791.00	0.04	a)
US20030NCT63	4.1500 % CMCSA 4.15 10/15/28	1'500	0	0	1'500 USD	97.02%	1'455'241.50	0.09	a)
US20030NCU37	4.2500 % CMCSA 4 1/4 10/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	95.52%	955'223.00	0.06	a)
US20030NCZ24	3.4500 % CMCSA 3.45 02/01/50	0	500	0	500 USD	71.62%	358'108.00	0.02	a)
US20030NDA63	2.6500 % CMCSA 2.65 02/01/30	500	0	0	500 USD	87.99%	439'966.50	0.03	a)
US20030NDG34	3.4000 % CMCSA 3.4 04/01/30	0	300	0	300 USD	91.37%	274'117.50	0.02	a)
US20030NDM02	1.9500 % CMCSA 1.95 01/15/31	500	0	0	500 USD	82.16%	410'815.00	0.03	a)
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	500	0	0	500 USD	79.68%	398'403.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US20030NDP33	2.4500 % CMCSA 2.45 08/15/52	0	400	0	400 USD	57.35%	229'397.60	0.01	a)
US20030NDS71	2.8870 % CMCSA 2.887 11/01/51	1'542	0	0	1'542 USD	63.57%	980'210.85	0.06	a)
US20030NDU28	2.9370 % CMCSA 2.937 11/01/56	1'819	300	0	2'119 USD	61.83%	1'310'207.37	0.08	a)
US20030NDW83	2.9870 % CMCSA 2.987 11/01/63	2'190	0	0	2'190 USD	59.90%	1'311'849.42	0.08	a)
US20030NDZ15	5.2500 % CMCSA 5 1/4 11/07/25	200	0	0	200 USD	100.44%	200'880.20	0.01	a)
US20030NEB38	5.5000 % CMCSA 5 1/2 11/15/32	0	300	0	300 USD	102.67%	308'013.60	0.02	a)
US20030NEC11	4.6500 % CMCSA 4.65 02/15/33	0	292	0	292 USD	97.13%	283'616.39	0.02	a)
US20030NEE76	4.8000 % CMCSA 4.8 05/15/33	0	260	0	260 USD	97.67%	253'949.80	0.02	a)
US20030NEF42	5.3500 % CMCSA 5.35 05/15/53	0	660	0	660 USD	96.93%	639'725.46	0.04	a)
US200340AT44	4.0000 % CMA 4 02/01/29	500	0	0	500 USD	90.55%	452'771.00	0.03	a)
US20268JAA16	2.7600 % CATMED 2.76 10/01/24	250	0	0	250 USD	98.38%	245'940.00	0.02	a)
US20268JAB98	3.3470 % CATMED 3.347 10/01/29	250	0	0	250 USD	90.75%	226'884.75	0.01	a)
US20268JAD54	3.8170 % CATMED 3.817 10/01/49	0	200	0	200 USD	76.56%	153'127.00	0.01	a)
US20268JAF03	2.7820 % CATMED 2.782 10/01/30	250	0	0	250 USD	85.35%	213'364.75	0.01	a)
US20268JAG85	3.9100 % CATMED 3.91 10/01/50	250	0	0	250 USD	76.46%	191'141.75	0.01	a)
US20268JAK97	6.0730 % CATMED 6.073 11/01/27	250	0	0	250 USD	102.22%	255'550.75	0.02	a)
US20271RAQ39	5.0790 % CBAAU 5.079 01/10/25	0	350	0	350 USD	99.83%	349'401.50	0.02	a)
US20271RAR12	5.3160 % CBAAU 5.316 03/13/26	0	300	0	300 USD	100.51%	301'540.80	0.02	a)
US20271RAS94	5.4990 % CBAAU 5.499 09/12/25	0	250	0	250 USD	100.56%	251'404.00	0.02	a)
US202795HK91	5.9000 % EXC 5.9 03/15/36	0	200	0	200 USD	104.58%	209'167.80	0.01	a)
US202795JH45	2.5500 % EXC 2.55 06/15/26	500	0	0	500 USD	94.66%	473'311.50	0.03	a)
US202795JM30	4.0000 % EXC 4 03/01/48	500	0	0	500 USD	80.79%	403'945.00	0.03	a)
US202795JN13	3.7000 % EXC 3.7 08/15/28	500	0	0	500 USD	95.20%	476'014.00	0.03	a)
US202795JT82	3.1250 % EXC 3 1/8 03/15/51 130	500	0	0	500 USD	67.30%	336'514.00	0.02	a)
US202795JY77	5.3000 % EXC 5.3 02/01/53	300	200	0	500 USD	96.90%	484'501.00	0.03	a)
US205887CA82	4.3000 % CAG 4.3 05/01/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US205887CB65	4.6000 % CAG 4.6 11/01/25	200	0	0	200 USD	98.49%	196'982.80	0.01	a)
US205887CC49	4.8500 % CAG 4.85 11/01/28	500	0	0	500 USD	98.44%	492'191.50	0.03	a)
US205887CD22	5.3000 % CAG 5.3 11/01/38	250	0	0	250 USD	94.52%	236'302.50	0.01	a)
US205887CE05	5.4000 % CAG 5.4 11/01/48	400	200	0	600 USD	91.98%	551'856.60	0.03	a)
US205887CF79	1.3750 % CAG 1 3/8 11/01/27	0	300	0	300 USD	86.99%	260'973.00	0.02	a)
US205887CJ91	5.3000 % CAG 5.3 10/01/26	0	150	0	150 USD	99.98%	149'974.35	0.01	a)
US20602DAA90	6.6500 % CNXC 6.65 08/02/26	0	250	0	250 USD	101.26%	253'138.00	0.02	a)
US20602DAB73	6.6000 % CNXC 6.6 08/02/28	0	250	0	250 USD	100.65%	251'624.00	0.02	a)
US20602DAC56	6.8500 % CNXC 6.85 08/02/33	0	250	0	250 USD	97.70%	244'258.75	0.02	a)
US207597EJ05	3.2000 % ES 3.2 03/15/27 A	0	100	0	100 USD	94.79%	94'794.30	0.01	a)
US207597EL50	4.0000 % ES 4 04/01/48	250	0	0	250 USD	81.46%	203'651.25	0.01	a)
US207597EP64	5.2500 % ES 5 1/4 01/15/53	300	0	0	300 USD	97.30%	291'895.50	0.02	a)
US20825CAF14	5.9000 % COP 5.9 10/15/32	250	0	0	250 USD	106.70%	266'744.75	0.02	a)
US20825CAQ78	6.5000 % COP 6 1/2 02/01/39	500	0	0	500 USD	112.91%	564'552.50	0.04	a)
US20826FAC05	4.3000 % COP 4.3 11/15/44	250	0	0	250 USD	86.16%	215'411.50	0.01	a)
US20826FAV85	3.8000 % COP 3.8 03/15/52	500	0	0	500 USD	76.69%	383'472.00	0.02	a)
US20826FBC95	3.7580 % COP 3.758 03/15/42	450	0	0	450 USD	81.12%	365'035.05	0.02	a)
US20826FBD78	4.0250 % COP 4.025 03/15/62	1'520	0	0	1'520 USD	77.09%	1'171'842.48	0.07	a)
US209111EY58	5.5000 % ED 5 1/2 12/01/39 09C	290	0	0	290 USD	99.22%	287'734.81	0.02	a)
US209111FC20	3.9500 % ED 3.95 03/01/43	250	0	0	250 USD	81.52%	203'796.50	0.01	a)
US209111FD03	4.4500 % ED 4.45 03/15/44	350	0	0	350 USD	86.48%	302'694.35	0.02	a)
US209111FF50	4.6250 % ED 4 5/8 12/01/54	650	0	0	650 USD	85.63%	556'590.45	0.03	a)
US209111FH17	3.8500 % ED 3.85 06/15/46	200	0	0	200 USD	78.30%	156'604.80	0.01	a)
US209111FK46	4.3000 % ED 4.3 12/01/56 C	250	0	0	250 USD	81.60%	203'995.75	0.01	a)
US209111FS71	4.0000 % ED 4 12/01/28 D	0	150	0	150 USD	96.19%	144'289.20	0.01	a)
US209111FV01	4.1250 % ED 4 1/8 05/15/49 A	500	0	0	500 USD	80.47%	402'344.50	0.03	a)
US209111FW83	3.7000 % ED 3.7 11/15/59	500	0	0	500 USD	71.85%	359'274.50	0.02	a)
US209111FX66	3.3500 % ED 3.35 04/01/30 20A	500	0	0	500 USD	91.26%	456'323.50	0.03	a)
US209111FY40	3.9500 % ED 3.95 04/01/50 20B	0	300	0	300 USD	80.15%	240'445.80	0.02	a)
US209111GA54	2.4000 % ED 2.4 06/15/31	500	0	0	500 USD	83.93%	419'658.00	0.03	a)
US209111GB38	3.6000 % ED 3.6 06/15/61	250	0	0	250 USD	71.84%	179'610.25	0.01	a)
US209111GC11	3.2000 % ED 3.2 12/01/51	0	200	0	200 USD	68.09%	136'179.40	0.01	a)
US209111GD93	6.1500 % ED 6.15 11/15/52	0	200	0	200 USD	108.58%	217'157.60	0.01	a)
US209111GF42	5.5000 % ED 5 1/2 03/15/34	0	500	0	500 USD	101.96%	509'802.00	0.03	a)
US209111GG25	5.9000 % ED 5.9 11/15/53	0	250	0	250 USD	104.89%	262'215.75	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 USD	in % 7)	Kat.
US21036PAQ19	3.7000 % STZ 3.7 12/06/26	500	0	0	500 USD	96.38%	481'891.50	0.03	a)
US21036PAS74	3.5000 % STZ 3 1/2 05/09/27	100	0	0	100 USD	95.14%	95'144.70	0.01	a)
US21036PAT57	4.5000 % STZ 4 1/2 05/09/47	0	150	0	150 USD	84.85%	127'281.30	0.01	a)
US21036PAY43	3.6000 % STZ 3.6 02/15/28	500	0	0	500 USD	94.54%	472'689.00	0.03	a)
US21036PAZ18	4.1000 % STZ 4.1 02/15/48	250	0	0	250 USD	80.64%	201'595.50	0.01	a)
US21036PBD96	5.2500 % STZ 5 1/4 11/15/48	0	240	0	240 USD	94.28%	226'276.32	0.01	a)
US21036PBE79	3.1500 % STZ 3.15 08/01/29	500	0	0	500 USD	90.85%	454'272.50	0.03	a)
US21036PBG28	3.7500 % STZ 3 3/4 05/01/50	0	270	0	270 USD	75.46%	203'737.41	0.01	a)
US21036PBH01	2.2500 % STZ 2 1/4 08/01/31	0	200	0	200 USD	81.67%	163'333.60	0.01	a)
US21036PBL13	4.7500 % STZ 4 3/4 05/09/32	500	0	0	500 USD	96.49%	482'426.50	0.03	a)
US21036PBP27	4.9000 % STZ 4.9 05/01/33	0	220	0	220 USD	96.83%	213'018.08	0.01	a)
US210385AB64	5.6000 % CEG 5.6 03/01/28	0	200	0	200 USD	101.38%	202'760.40	0.01	a)
US210385AC48	5.8000 % CEG 5.8 03/01/33	0	150	0	150 USD	102.16%	153'242.10	0.01	a)
US210385AD21	6.1250 % CEG 6 1/8 01/15/34	0	150	0	150 USD	104.35%	156'529.80	0.01	a)
US210385AE04	6.5000 % CEG 6 1/2 10/01/53	0	450	0	450 USD	109.90%	494'533.35	0.03	a)
US210518DB95	4.0500 % CMS 4.05 05/15/48	1'000	0	0	1'000 USD	83.17%	831'684.00	0.05	a)
US210518DU76	4.6250 % CMS 4 5/8 05/15/33	0	200	0	200 USD	96.40%	192'790.20	0.01	a)
US21684AAB26	5.7500 % RABOBK 5 3/4 12/01/43	500	0	0	500 USD	100.84%	504'176.50	0.03	a)
US21684AAC09	4.3750 % RABOBK 4 3/8 08/04/25	750	0	0	750 USD	98.30%	737'266.50	0.05	a)
US21684AAD81	5.2500 % RABOBK 5 1/4 08/04/45	750	0	0	750 USD	97.37%	730'252.50	0.05	a)
US21684AAF30	3.7500 % RABOBK 3 3/4 07/21/26 BKNT	550	0	0	550 USD	95.77%	526'713.00	0.03	a)
US21685WCJ45	5.2500 % RABOBK 5 1/4 05/24/41 BKNT	550	0	0	550 USD	101.09%	556'006.00	0.03	a)
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	500	0	0	500 USD	97.89%	489'435.50	0.03	a)
US21688AAS15	1.3750 % RABOBK 1 3/8 01/10/25	250	0	0	250 USD	96.73%	241'835.00	0.02	a)
US21871XAA72	3.5000 % CRBG 3 1/2 04/04/25 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAB55	3.5000 % CRBG 3 1/2 04/04/25	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAC39	3.6500 % CRBG 3.65 04/05/27 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAD12	3.6500 % CRBG 3.65 04/05/27	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAG43	3.9000 % CRBG 3.9 04/05/32 144A	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAH26	3.9000 % CRBG 3.9 04/05/32	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAL38	4.4000 % CRBG 4.4 04/05/52 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAM11	4.4000 % CRBG 4.4 04/05/52	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US21871XAQ25	6.0500 % CRBG 6.05 09/15/33 144A	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219350BF12	4.3750 % GLW 4 3/8 11/15/57	500	0	0	500 USD	81.77%	408'842.00	0.03	a)
US219350BK07	5.3500 % GLW 5.35 11/15/48	0	160	0	160 USD	95.84%	153'349.44	0.01	a)
US22160KAM71	3.0000 % COST 3 05/18/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.16%	951'642.00	0.06	a)
US22160KAQ85	1.7500 % COST 1 3/4 04/20/32	500	0	0	500 USD	79.88%	399'407.00	0.02	a)
US225401AP33	4.1940 % UBS 4.194 04/01/31 144A	750	0	0	750 USD	92.01%	690'074.25	0.04	a)
US22541LAE39	7.1250 % UBS 7 1/8 07/15/32	500	0	0	500 USD	111.71%	558'559.50	0.03	a)
US225433AC55	3.7500 % UBS 3 3/4 03/26/25	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US225433AF86	4.8750 % UBS 4 7/8 05/15/45	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US225433AR25	4.5500 % UBS 4.55 04/17/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22550L2C42	2.9500 % UBS 2.95 04/09/25	500	0	0	500 USD	97.13%	485'630.00	0.03	a)
US22550L2E08	0.4950 % UBS 0.495 02/02/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22550L2G55	1.2500 % UBS 1 1/4 08/07/26	0	450	0	450 USD	91.12%	410'033.25	0.03	a)
US22550L2H39	3.7000 % UBS 3.7 02/21/25 MTN	300	0	0	300 USD	98.12%	294'364.20	0.02	a)
US22550L2L41	7.9500 % UBS 7.95 01/09/25	0	250	0	250 USD	101.86%	254'645.00	0.02	a)
US22550L2M24	7.5000 % UBS 7 1/2 02/15/28	300	250	0	550 USD	107.27%	589'976.20	0.04	a)
US22822VAC54	3.7000 % CCI 3.7 06/15/26	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAE11	4.0000 % CCI 4 03/01/27	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAG68	3.2000 % CCI 3.2 09/01/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAH42	3.6500 % CCI 3.65 09/01/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAK70	3.8000 % CCI 3.8 02/15/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAL53	4.3000 % CCI 4.3 02/15/29	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAQ41	4.1500 % CCI 4.15 07/01/50	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAT89	2.2500 % CCI 2 1/4 01/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAU52	3.2500 % CCI 3 1/4 01/15/51	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAV36	1.0500 % CCI 1.05 07/15/26	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAW19	2.1000 % CCI 2.1 04/01/31	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US22822VAX91	2.9000 % CCI 2.9 04/01/41	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US231021AS53	2.6000 % CMI 2.6 09/01/50	250	0	0	250 USD	62.63%	156'586.50	0.01	a)
US231021AU00	0.7500 % CMI 0 3/4 09/01/25	250	0	0	250 USD	93.81%	234'512.75	0.01	a)
US23291KAG04	2.2000 % DHR 2.2 11/15/24	200	0	0	200 USD	97.80%	195'590.00	0.01	a)
US23291KAH86	2.6000 % DHR 2.6 11/15/29	200	0	0	200 USD	88.62%	177'235.40	0.01	a)
US23291KAJ43	3.2500 % DHR 3 1/4 11/15/39	500	0	0	500 USD	79.33%	396'654.50	0.02	a)
US23291KAK16	3.4000 % DHR 3.4 11/15/49	500	100	0	600 USD	74.75%	448'491.00	0.03	a)
US23311VAG23	5.3750 % DCP 5 3/8 07/15/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US23311VAJ61	5.6250 % DCP 5 5/8 07/15/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US233331AY31	2.8500 % DTE 2.85 10/01/26	250	0	0	250 USD	94.14%	235'357.00	0.01	a)
US23338VAJ52	3.9500 % DTE 3.95 03/01/49	0	200	0	200 USD	80.83%	161'653.40	0.01	a)
US23338VAQ95	3.0000 % DTE 3 03/01/32 A	200	0	0	200 USD	86.36%	172'711.20	0.01	a)
US23355LAL09	1.8000 % DXC 1.8 09/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	90.53%	905'294.00	0.06	a)
US23355LAM81	2.3750 % DXC 2 3/8 09/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	85.74%	857'446.00	0.05	a)
US233835AQ08	8.5000 % MBGGR 8 1/2 01/18/31	540	0	0	540 USD	121.17%	654'295.86	0.04	a)
US235851AW20	2.8000 % DHR 2.8 12/10/51	200	0	0	200 USD	64.73%	129'457.20	0.01	a)
US237194AL90	3.8500 % DRI 3.85 05/01/27	0	150	0	150 USD	95.82%	143'729.40	0.01	a)
US237194AN56	6.3000 % DRI 6.3 10/10/33	0	200	0	200 USD	104.22%	208'447.00	0.01	a)
US244199BF15	3.9000 % DE 3.9 06/09/42	510	0	0	510 USD	85.52%	436'144.35	0.03	a)
US244199BJ37	3.1000 % DE 3.1 04/15/30	500	0	0	500 USD	90.82%	454'075.50	0.03	a)
US244199BK00	3.7500 % DE 3 3/4 04/15/50	500	0	0	500 USD	81.83%	409'130.50	0.03	a)
US24422ESP50	3.3500 % DE 3.35 06/12/24 MTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422ETW92	2.8000 % DE 2.8 09/08/27 MTN	500	0	0	500 USD	93.63%	468'138.50	0.03	a)
US24422EUU18	3.4500 % DE 3.45 03/07/29 MTN	0	200	0	200 USD	94.28%	188'568.40	0.01	a)
US24422EUY30	2.8000 % DE 2.8 07/18/29 MTN	250	0	0	250 USD	90.87%	227'186.25	0.01	a)
US24422EVC01	2.0500 % DE 2.05 01/09/25 MTN	400	0	0	400 USD	97.41%	389'644.00	0.02	a)
US24422EVD83	2.4500 % DE 2.45 01/09/30 MTN	0	160	0	160 USD	87.91%	140'663.84	0.01	a)
US24422EVK27	0.7000 % DE 0.7 01/15/26 MTN	500	0	0	500 USD	92.52%	462'623.50	0.03	a)
US24422EVL00	1.4500 % DE 1.45 01/15/31	250	0	0	250 USD	80.65%	201'628.25	0.01	a)
US24422EVN65	0.4500 % DE 0.45 01/17/24 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24422EVP14	1.5000 % DE 1 1/2 03/06/28 MTN	0	150	0	150 USD	88.12%	132'179.55	0.01	a)
US24422EVS52	2.0000 % DE 2 06/17/31 MTN	250	0	0	250 USD	82.70%	206'738.75	0.01	a)
US24422EVY21	1.2500 % DE 1 1/4 01/10/25 MTN	600	0	0	600 USD	96.71%	580'242.00	0.04	a)
US24422EWA36	1.7000 % DE 1.7 01/11/27 MTN	250	0	0	250 USD	91.54%	228'844.25	0.01	a)
US24422EWK18	4.1500 % DE 4.15 09/15/27 MTN	0	250	0	250 USD	97.87%	244'683.25	0.02	a)
US24422EWL90	4.3500 % DE 4.35 09/15/32 MTN	300	0	0	300 USD	96.91%	290'742.00	0.02	a)
US24422EWP05	4.8000 % DE 4.8 01/09/26 MTN	0	300	0	300 USD	99.75%	299'246.10	0.02	a)
US24422EWR60	4.7500 % DE 4 3/4 01/20/28 MTN	0	350	0	350 USD	99.74%	349'099.10	0.02	a)
US24422EWT27	5.0500 % DE 5.05 03/03/26 FXD	0	250	0	250 USD	100.19%	250'483.50	0.02	a)
US24422EWW72	4.9000 % DE 4.9 03/03/28 MTN	0	200	0	200 USD	100.50%	200'994.40	0.01	a)
US24422EWWW55	4.9500 % DE 4.95 06/06/25 MTN	0	200	0	200 USD	99.84%	199'681.00	0.01	a)
US24422EWX39	4.7500 % DE 4 3/4 06/08/26 MTN	0	250	0	250 USD	99.71%	249'284.75	0.02	a)
US24422EWZ86	4.7000 % DE 4.7 06/10/30 MTN	0	250	0	250 USD	99.04%	247'600.75	0.02	a)
US24422EXB00	4.9500 % DE 4.95 07/14/28 MTN	0	425	0	425 USD	100.53%	427'244.00	0.03	a)
US24422EXD65	5.1500 % DE 5.15 09/08/26 MTN	0	150	0	150 USD	100.63%	150'943.65	0.01	a)
US24422EXE49	5.1500 % DE 5.15 09/08/33 I	0	300	0	300 USD	101.72%	305'169.00	0.02	a)
US24703DBF78	3.3750 % DELL 3 3/8 12/15/41	0	300	0	300 USD	73.27%	219'821.40	0.01	a)
US24703DBG51	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51 144A	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703DBH35	3.4500 % DELL 3.45 12/15/51	0	500	0	500 USD	68.89%	344'440.00	0.02	a)
US24703DBJ90	5.2500 % DELL 5 1/4 02/01/28	0	300	0	300 USD	100.50%	301'503.90	0.02	a)
US24703DBL47	5.7500 % DELL 5 3/4 02/01/33	0	290	0	290 USD	102.91%	298'434.36	0.02	a)
US24703TAB26	4.0000 % DELL 4 07/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US24703TAC09	5.8500 % DELL 5.85 07/15/25	500	0	0	500 USD	100.26%	501'284.50	0.03	a)
US24703TAD81	6.0200 % DELL 6.02 06/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	101.12%	2'022'418.00	0.13	a)
US24703TAE64	4.9000 % DELL 4.9 10/01/26	500	0	0	500 USD	99.16%	495'782.00	0.03	a)
US24703TAG13	5.3000 % DELL 5.3 10/01/29	0	800	0	800 USD	100.17%	801'388.00	0.05	a)
US24703TAH95	6.2000 % DELL 6.2 07/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	104.74%	1'047'380.00	0.07	a)
US24703TAJ51	8.1000 % DELL 8.1 07/15/36	0	290	0	290 USD	119.93%	347'803.38	0.02	a)
US247361ZN12	4.3750 % DAL 4 3/8 04/19/28	500	0	0	500 USD	95.88%	479'375.00	0.03	a)
US247361ZT81	3.7500 % DAL 3 3/4 10/28/29	0	200	0	200 USD	90.88%	181'750.00	0.01	a)
US247361ZZ42	7.3750 % DAL 7 3/8 01/15/26	300	0	0	300 USD	103.25%	309'750.00	0.02	a)
US24906PAA75	3.2500 % XRAY 3 1/4 06/01/30	0	200	0	200 USD	87.13%	174'265.60	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US251526CB33	3.9610 % DB 3.961 11/26/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CD98	3.5470 % DB 3.547 09/18/31	1'000	0	0	1'000 USD	85.98%	859'823.00	0.05 a)	
US251526CE71	2.1290 % DB 2.129 11/24/26	500	0	0	500 USD	93.64%	468'180.00	0.03 a)	
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US251526CK32	3.0350 % DB 3.035 05/28/32	300	0	0	300 USD	82.21%	246'615.30	0.02 a)	
US251526CP29	2.3110 % DB 2.311 11/16/27	0	400	0	400 USD	91.02%	364'096.00	0.02 a)	
US251526CS67	6.7200 % DB 6.72 01/18/29	0	550	0	550 USD	102.23%	562'287.55	0.04 a)	
US251526CT41	7.0790 % DB 7.079 02/10/34	0	450	0	450 USD	100.03%	450'140.40	0.03 a)	
US251526CU14	6.8190 % DB 6.819 11/20/29	0	450	0	450 USD	103.16%	464'227.65	0.03 a)	
US25152RXA66	3.7000 % DB 3.7 05/30/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25156PAC77	8.7500 % DT 8 1/4 06/15/30	1'180	0	0	1'180 USD	117.84%	1'390'489.58	0.09 a)	
US25156PAD50	9.2500 % DT 9 1/4 06/01/32	300	400	0	700 USD	126.13%	882'910.00	0.06 a)	
US25160PAF45	1.6860 % DB 1.686 03/19/26	500	0	0	500 USD	92.99%	464'943.50	0.03 a)	
US25160PAG28	3.7420 % DB 3.742 01/07/33	400	0	0	400 USD	80.68%	322'739.20	0.02 a)	
US25160PAH01	2.5520 % DB 2.552 01/07/28	0	380	0	380 USD	90.98%	345'742.62	0.02 a)	
US25160PAJ66	6.1190 % DB 6.119 07/14/26	0	500	0	500 USD	100.29%	501'467.00	0.03 a)	
US25160PAN78	7.1460 % DB 7.146 07/13/27	0	360	0	360 USD	102.68%	369'662.40	0.02 a)	
US25179MAL72	5.6000 % DVN 5.6 07/15/41	300	0	0	300 USD	94.14%	282'411.30	0.02 a)	
US25179MAN39	4.7500 % DVN 4 3/4 05/15/42	250	0	0	250 USD	84.55%	211'367.75	0.01 a)	
US25179MAU71	5.0000 % DVN 5 06/15/45	500	0	0	500 USD	86.64%	433'204.50	0.03 a)	
US25179MBF95	4.5000 % DVN 4 1/2 01/15/30	500	0	0	500 USD	95.30%	476'499.00	0.03 a)	
US25179SAD27	7.8750 % DVN 7 7/8 09/30/31	400	0	0	400 USD	113.25%	453'000.00	0.03 a)	
US25243YAV11	3.8750 % DGELN 3 7/8 04/29/43	100	0	0	100 USD	84.26%	84'263.40	0.01 a)	
US25243YAZ25	3.8750 % DGELN 3 7/8 05/18/28	1'000	0	0	1'000 USD	96.49%	964'855.00	0.06 a)	
US25243YBB48	2.3750 % DGELN 2 3/8 10/24/29	1'000	0	0	1'000 USD	87.64%	876'443.00	0.05 a)	
US25243YBH18	5.5000 % DGELN 5 1/2 01/24/33	400	0	0	400 USD	102.45%	409'806.00	0.03 a)	
US25243YBK47	5.3750 % DGELN 5 3/8 10/05/26	0	250	0	250 USD	100.89%	252'233.50	0.02 a)	
US25243YBN85	5.6250 % DGELN 5 5/8 10/05/33	0	250	0	250 USD	103.96%	259'894.25	0.02 a)	
US25278XAM11	3.2500 % FANG 3 1/4 12/01/26	0	230	0	230 USD	95.62%	219'923.47	0.01 a)	
US25278XAN93	3.5000 % FANG 3 1/2 12/01/29	0	290	0	290 USD	91.67%	265'853.73	0.02 a)	
US25278XAQ25	4.4000 % FANG 4.4 03/24/51	0	200	0	200 USD	81.57%	163'139.00	0.01 a)	
US25278XAR08	3.1250 % FANG 3 1/8 03/24/31	0	240	0	240 USD	87.67%	210'404.40	0.01 a)	
US25278XAT63	4.2500 % FANG 4 1/4 03/15/52	0	230	0	230 USD	79.26%	182'307.20	0.01 a)	
US25278XAV10	6.2500 % FANG 6 1/4 03/15/33	0	340	0	340 USD	105.40%	358'352.18	0.02 a)	
US25278XAW92	6.2500 % FANG 6 1/4 03/15/53	0	200	0	200 USD	106.08%	212'162.40	0.01 a)	
US253393AF94	3.1500 % DKS 3.15 01/15/32	0	250	0	250 USD	84.01%	210'018.25	0.01 a)	
US253393AG77	4.1000 % DKS 4.1 01/15/52	0	300	0	300 USD	70.43%	211'284.90	0.01 a)	
US25389JAR77	3.7000 % DLR 3.7 08/15/27	600	0	0	600 USD	95.38%	572'250.00	0.04 a)	
US25389JAT34	4.4500 % DLR 4.45 07/15/28	500	0	0	500 USD	96.68%	483'414.50	0.03 a)	
US25466AAP66	4.6500 % DFS 4.65 09/13/28 BKNT	0	250	0	250 USD	95.19%	237'963.25	0.01 a)	
US254687CZ75	3.7000 % DIS 3.7 09/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US254687DD54	3.7000 % DIS 3.7 10/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.73%	977'304.00	0.06 a)	
US254687DZ66	6.2000 % DIS 6.2 12/15/34	100	0	0	100 USD	108.82%	108'816.40	0.01 a)	
US254687EB89	6.4000 % DIS 6.4 12/15/35	500	0	0	500 USD	110.72%	553'615.50	0.03 a)	
US254687EH59	6.6500 % DIS 6.65 11/15/37	400	0	0	400 USD	112.81%	451'248.40	0.03 a)	
US254687ER32	6.1500 % DIS 6.15 02/15/41	360	0	0	360 USD	107.76%	387'933.48	0.02 a)	
US254687ET97	5.4000 % DIS 5.4 10/01/43	250	0	0	250 USD	99.88%	249'689.50	0.02 a)	
US254687EV44	4.7500 % DIS 4 3/4 09/15/44	250	0	0	250 USD	91.74%	229'343.25	0.01 a)	
US254687FK79	1.7500 % DIS 1 3/4 08/30/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US254687FL52	2.0000 % DIS 2 09/01/29	500	0	0	500 USD	86.18%	430'876.00	0.03 a)	
US254687FM36	2.7500 % DIS 2 3/4 09/01/49	500	0	0	500 USD	64.54%	322'684.00	0.02 a)	
US254687FN19	3.3500 % DIS 3.35 03/24/25	500	0	0	500 USD	97.99%	489'949.50	0.03 a)	
US254687FS06	4.7000 % DIS 4.7 03/23/50	500	0	0	500 USD	91.24%	456'216.00	0.03 a)	
US254687FX90	2.6500 % DIS 2.65 01/13/31	1'500	0	0	1'500 USD	86.90%	1'303'467.00	0.08 a)	
US254687FZ49	3.6000 % DIS 3.6 01/13/51	500	0	0	500 USD	75.74%	378'721.00	0.02 a)	
US25468PCX24	3.7000 % DIS 3.7 12/01/42 MTN	250	0	0	250 USD	80.63%	201'579.25	0.01 a)	
US25468PDB94	4.1250 % DIS 4 1/8 06/01/44 GMTN	300	0	0	300 USD	85.34%	256'008.60	0.02 a)	
US25468PDF09	3.1500 % DIS 3.15 09/17/25 GMTN	400	0	0	400 USD	96.92%	387'690.80	0.02 a)	
US25468PDM59	1.8500 % DIS 1.85 07/30/26 MTN	500	0	0	500 USD	92.84%	464'182.50	0.03 a)	
US25468PDN33	3.0000 % DIS 3 07/30/46 MTN	500	0	0	500 USD	69.47%	347'347.50	0.02 a)	
US25468PDV58	2.9500 % DIS 2.95 06/15/27 MTN	882	0	0	882 USD	94.55%	833'920.42	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 USD	in % 7)	Kat.
US254709AM01	4.1000 % DFS 4.1 02/09/27	0	400	0	400 USD	96.20%	384'810.00	0.02	a)
US254709AP32	4.5000 % DFS 4 1/2 01/30/26	0	400	0	400 USD	98.51%	394'023.20	0.02	a)
US254709AS70	6.7000 % DFS 6.7 11/29/32	0	250	0	250 USD	104.17%	260'420.75	0.02	a)
US254709AT53	7.9640 % DFS 7.964 11/02/34	0	550	0	550 USD	112.26%	617'411.30	0.04	a)
US25470DAD12	6.3500 % WBD 6.35 06/01/40	0	200	0	200 USD	96.00%	192'005.40	0.01	a)
US25470DAJ81	4.8750 % WBD 4 7/8 04/01/43	0	200	0	200 USD	80.07%	160'144.60	0.01	a)
US25470DAR08	3.9500 % WBD 3.95 03/20/28	0	800	0	800 USD	93.71%	749'661.60	0.05	a)
US25470DAS80	5.0000 % WBD 5 09/20/37	0	100	0	100 USD	85.79%	85'790.90	0.01	a)
US25470DAT63	5.2000 % WBD 5.2 09/20/47	0	500	0	500 USD	81.12%	405'601.50	0.03	a)
US25470DBG34	5.3000 % WBD 5.3 05/15/49	0	300	0	300 USD	81.86%	245'570.70	0.02	a)
US25470DBH17	4.6500 % WBD 4.65 05/15/50	0	200	0	200 USD	75.60%	151'209.00	0.01	a)
US25470DBL29	4.0000 % WBD 4 09/15/55	0	400	0	400 USD	65.97%	263'876.40	0.02	a)
US256677AD70	4.1500 % DG 4.15 11/01/25	0	410	0	410 USD	97.91%	401'426.08	0.03	a)
US256677AF29	4.1250 % DG 4 1/8 05/01/28	0	200	0	200 USD	96.46%	192'923.20	0.01	a)
US256677AG02	3.5000 % DG 3 1/2 04/03/30	0	300	0	300 USD	90.41%	271'238.70	0.02	a)
US256677AH84	4.1250 % DG 4 1/8 04/03/50	0	160	0	160 USD	76.25%	121'992.00	0.01	a)
US256677AK14	4.6250 % DG 4 5/8 11/01/27	0	170	0	170 USD	97.93%	166'489.33	0.01	a)
US256677AL96	5.0000 % DG 5 11/01/32	0	220	0	220 USD	97.10%	213'624.40	0.01	a)
US256677AN52	5.2000 % DG 5.2 07/05/28	0	160	0	160 USD	99.90%	159'847.36	0.01	a)
US256677AP01	5.4500 % DG 5.45 07/05/33	0	310	0	310 USD	99.49%	308'423.65	0.02	a)
US256746AH16	4.2000 % DLTR 4.2 05/15/28	0	500	0	500 USD	96.36%	481'789.50	0.03	a)
US256746AJ71	2.6500 % DLTR 2.65 12/01/31	0	250	0	250 USD	83.18%	207'937.50	0.01	a)
US257469AJ58	5.2500 % D 5 1/4 08/01/33 F	350	0	0	350 USD	97.97%	342'899.55	0.02	a)
US25746UBM09	4.9000 % D 4.9 08/01/41 C	80	0	0	80 USD	89.81%	71'847.44	0.00	a)
US25746UBY47	5.7500 % D 5 3/4 10/01/54	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US25746UCE73	3.9000 % D 3.9 10/01/25	450	0	0	450 USD	97.72%	439'751.25	0.03	a)
US25746UDG13	3.3750 % D 3 3/8 04/01/30 C	500	0	0	500 USD	89.97%	449'865.00	0.03	a)
US25746UDL08	2.2500 % D 2 1/4 08/15/31 C	500	500	0	1'000 USD	80.97%	809'748.00	0.05	a)
US25746UDQ94	4.8500 % D 4.85 08/15/52 B	200	0	0	200 USD	87.69%	175'389.00	0.01	a)
US260543BJ10	7.3750 % DOW 7 3/8 11/01/29	180	0	0	180 USD	110.80%	199'447.20	0.01	a)
US260543CE14	5.2500 % DOW 5 1/4 11/15/41	500	0	0	500 USD	94.16%	470'780.00	0.03	a)
US260543CG61	4.3750 % DOW 4 3/8 11/15/42	500	0	0	500 USD	84.08%	420'422.00	0.03	a)
US260543CK73	4.2500 % DOW 4 1/4 10/01/34	500	0	0	500 USD	91.81%	459'034.00	0.03	a)
US260543CL56	4.6250 % DOW 4 5/8 10/01/44	300	0	0	300 USD	86.62%	259'860.30	0.02	a)
US260543CV39	4.8000 % DOW 4.8 05/15/49	200	0	0	200 USD	86.63%	173'262.80	0.01	a)
US260543CY77	4.8000 % DOW 4.8 11/30/28	200	0	0	200 USD	99.08%	198'162.00	0.01	a)
US260543DD22	3.6000 % DOW 3.6 11/15/50	500	0	0	500 USD	72.83%	364'136.00	0.02	a)
US260543DG52	6.3000 % DOW 6.3 03/15/33	0	200	0	200 USD	107.01%	214'013.20	0.01	a)
US260543DH36	6.9000 % DOW 6.9 05/15/53	0	200	0	200 USD	113.90%	227'808.40	0.01	a)
US26078JAC45	4.4930 % DD 4.493 11/15/25	0	570	0	570 USD	98.82%	563'286.54	0.04	a)
US26078JAD28	4.7250 % DD 4.725 11/15/28	0	700	0	700 USD	99.30%	695'067.10	0.04	a)
US26078JAE01	5.3190 % DD 5.319 11/15/38	0	525	0	525 USD	99.02%	519'873.90	0.03	a)
US26078JAF75	5.4190 % DD 5.419 11/15/48	0	750	0	750 USD	98.06%	735'432.75	0.05	a)
US26138EAS81	3.4000 % KDP 3.4 11/15/25	250	0	0	250 USD	96.84%	242'090.75	0.02	a)
US26138EAT64	4.5000 % KDP 4 1/2 11/15/45	250	0	0	250 USD	86.64%	216'602.00	0.01	a)
US263534CP24	2.3000 % CTVA 2.3 07/15/30	200	0	0	200 USD	85.69%	171'378.40	0.01	a)
US263534CR89	4.8000 % CTVA 4.8 05/15/33	0	170	0	170 USD	97.83%	166'312.19	0.01	a)
US263901AA85	6.3500 % DUK 6.35 08/15/38	300	0	0	300 USD	107.01%	321'020.40	0.02	a)
US26441CAS44	2.6500 % DUK 2.65 09/01/26	1'000	400	0	1'400 USD	94.15%	1'318'107.00	0.08	a)
US26441CAT27	3.7500 % DUK 3 3/4 09/01/46	450	0	0	450 USD	74.08%	333'370.35	0.02	a)
US26441CAY12	3.9500 % DUK 3.95 08/15/47	250	0	0	250 USD	76.54%	191'347.75	0.01	a)
US26441CBM64	3.3000 % DUK 3.3 06/15/41	0	300	0	300 USD	73.47%	220'421.40	0.01	a)
US26441CBT18	4.5000 % DUK 4 1/2 08/15/32	0	500	0	500 USD	93.86%	469'322.00	0.03	a)
US26441CBLU80	5.0000 % DUK 5 08/15/52	700	0	0	700 USD	89.15%	624'026.20	0.04	a)
US26441CCA18	6.1000 % DUK 6.1 09/15/53	0	700	0	700 USD	103.68%	725'776.80	0.05	a)
US26442CAB00	6.0000 % DUK 6 01/15/38	0	150	0	150 USD	103.66%	155'484.30	0.01	a)
US26442CAH79	5.3000 % DUK 5.3 02/15/40	300	0	0	300 USD	98.23%	294'694.50	0.02	a)
US26442CAM64	4.2500 % DUK 4 1/4 12/15/41	250	0	0	250 USD	84.97%	212'433.25	0.01	a)
US26442CAN48	4.0000 % DUK 4 09/30/42	250	0	0	250 USD	82.43%	206'081.00	0.01	a)
US26442CAR51	3.8750 % DUK 3 7/8 03/15/46	500	0	0	500 USD	78.09%	390'472.50	0.02	a)
US26442CAU80	3.9500 % DUK 3.95 03/15/48	250	0	0	250 USD	79.21%	198'014.50	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US26442CAX20	3.9500 % DUK 3.95 11/15/28	700	0	0	700 USD	96.37%	674'572.50	0.04	a)
US26442CBJ27	4.9500 % DUK 4.95 01/15/33	0	700	0	700 USD	98.70%	690'922.40	0.04	a)
US26442CBK99	5.3500 % DUK 5.35 01/15/53	0	200	0	200 USD	97.75%	195'499.60	0.01	a)
US26442CBL72	5.4000 % DUK 5.4 01/15/54	0	300	0	300 USD	97.46%	292'378.20	0.02	a)
US26442UAB08	4.2000 % DUK 4.2 08/15/45	500	0	0	500 USD	82.44%	412'179.00	0.03	a)
US26442UAG94	3.7000 % DUK 3.7 09/01/28	300	0	0	300 USD	95.72%	287'161.50	0.02	a)
US26442UAH77	3.4500 % DUK 3.45 03/15/29	500	0	0	500 USD	93.45%	467'254.00	0.03	a)
US26443TAB26	3.2500 % DUK 3 1/4 10/01/49 YYY	500	0	0	500 USD	69.07%	345'356.00	0.02	a)
US26444HAA95	3.4000 % DUK 3.4 10/01/46	400	0	0	400 USD	72.58%	290'329.20	0.02	a)
US26444HAC51	3.2000 % DUK 3.2 01/15/27	250	0	0	250 USD	95.73%	239'333.50	0.01	a)
US26444HAN17	5.9500 % DUK 5.95 11/15/52	0	200	0	200 USD	105.13%	210'261.80	0.01	a)
US26875PAN15	3.9000 % EOG 3.9 04/01/35	500	0	0	500 USD	89.52%	447'617.00	0.03	a)
US26875PAP62	4.1500 % EOG 4.15 01/15/26	200	0	0	200 USD	98.28%	196'557.20	0.01	a)
US26875PAU57	4.3750 % EOG 4 3/8 04/15/30	200	0	0	200 USD	96.90%	193'796.40	0.01	a)
US26884ABB89	4.5000 % EQR 4 1/2 07/01/44	350	100	0	450 USD	86.36%	388'633.50	0.02	a)
US26884ABJ16	3.5000 % EQR 3 1/2 03/01/28	300	0	0	300 USD	94.21%	282'628.20	0.02	a)
US26884ABM45	2.5000 % EQR 2 1/2 02/15/30	250	0	0	250 USD	86.96%	217'398.75	0.01	a)
US26884LAF67	3.9000 % EQT 3.9 10/01/27	0	350	0	350 USD	94.78%	331'732.10	0.02	a)
US26884LAG41	7.0000 % EQT 7 02/01/30	0	300	0	300 USD	105.64%	316'906.50	0.02	a)
US26884LAQ23	5.7000 % EQT 5.7 04/01/28	0	200	0	200 USD	100.70%	201'398.20	0.01	a)
US277432AP52	4.6500 % EMN 4.65 10/15/44	500	0	0	500 USD	84.91%	424'574.50	0.03	a)
US277432AR19	3.8000 % EMN 3.8 03/15/25	150	0	0	150 USD	98.42%	147'629.10	0.01	a)
US277432AW04	4.5000 % EMN 4 1/2 12/01/28	0	140	0	140 USD	96.72%	135'414.30	0.01	a)
US277432AX86	5.7500 % EMN 5 3/4 03/08/33	0	140	0	140 USD	100.61%	140'859.74	0.01	a)
US278062AD69	4.0000 % ETN 4 11/02/32	500	0	0	500 USD	93.61%	468'025.00	0.03	a)
US278062AH73	4.1500 % ETN 4.15 03/15/33	300	0	0	300 USD	93.91%	281'733.60	0.02	a)
US278062AJ30	4.7000 % ETN 4.7 08/23/52	500	0	0	500 USD	91.90%	459'484.00	0.03	a)
US278642AF09	4.0000 % EBAY 4 07/15/42	600	0	0	600 USD	79.16%	474'940.20	0.03	a)
US278642AL76	3.4500 % EBAY 3.45 08/01/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AU75	3.6000 % EBAY 3.6 06/05/27	500	0	0	500 USD	95.48%	477'391.00	0.03	a)
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	400	0	0	400 USD	96.45%	385'813.60	0.02	a)
US278642AW32	2.7000 % EBAY 2.7 03/11/30	500	0	0	500 USD	87.38%	436'886.00	0.03	a)
US278642AZ62	3.6500 % EBAY 3.65 05/10/51	0	300	0	300 USD	72.17%	216'502.20	0.01	a)
US278865AV25	2.7000 % ECL 2.7 11/01/26	250	0	0	250 USD	94.83%	237'067.25	0.01	a)
US278865BE90	4.8000 % ECL 4.8 03/24/30	500	0	0	500 USD	99.99%	499'959.50	0.03	a)
US278865BF65	1.3000 % ECL 1.3 01/30/31	500	0	0	500 USD	79.39%	396'954.00	0.02	a)
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	300	0	0	300 USD	62.01%	186'018.60	0.01	a)
US278865BM17	2.1250 % ECL 2 1/8 02/01/32	200	0	0	200 USD	81.92%	163'843.60	0.01	a)
US278865BN99	2.7000 % ECL 2.7 12/15/51	0	200	0	200 USD	63.35%	126'699.60	0.01	a)
US278865BP48	5.2500 % ECL 5 1/4 01/15/28	300	0	0	300 USD	101.45%	304'347.60	0.02	a)
US279158AE95	7.3750 % ECOPET 7 3/8 09/18/43	600	0	0	600 USD	91.00%	546'000.00	0.03	a)
US279158AJ82	5.8750 % ECOPET 5 7/8 05/28/45	750	0	0	750 USD	74.13%	555'937.50	0.03	a)
US279158AK55	4.1250 % ECOPET 4 1/8 01/16/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US279158AL39	5.3750 % ECOPET 5 3/8 06/26/26	450	0	0	450 USD	98.38%	442'687.50	0.03	a)
US279158AN94	6.8750 % ECOPET 6 7/8 04/29/30	800	0	0	800 USD	97.28%	778'240.00	0.05	a)
US279158AP43	4.6250 % ECOPET 4 5/8 11/02/31	0	360	0	360 USD	82.25%	296'100.00	0.02	a)
US279158AQ26	5.8750 % ECOPET 5 7/8 11/02/51	0	150	0	150 USD	70.63%	105'937.50	0.01	a)
US279158AS81	8.8750 % ECOPET 8 7/8 01/13/33	0	500	0	500 USD	105.15%	525'750.00	0.03	a)
US281020AM97	4.1250 % EIX 4 1/8 03/15/28	500	0	0	500 USD	95.37%	476'844.50	0.03	a)
US281020AN70	5.7500 % EIX 5 3/4 06/15/27	0	200	0	200 USD	100.99%	201'981.80	0.01	a)
US281020AQ02	3.5500 % EIX 3.55 11/15/24	250	0	0	250 USD	98.48%	246'190.00	0.02	a)
US281020AW79	6.9500 % EIX 6.95 11/15/29	0	250	0	250 USD	106.58%	266'440.75	0.02	a)
US281020AX52	8.1250 % EIX 8 1/8 06/15/53	0	150	0	150 USD	102.87%	154'308.90	0.01	a)
US281020AY36	5.2500 % EIX 5 1/4 11/15/28	0	400	0	400 USD	99.25%	396'982.00	0.02	a)
US28368EAD85	7.8000 % KMI 7.8 08/01/31 GMTN	350	0	0	350 USD	112.44%	393'551.20	0.02	a)
US28368EAE68	7.7500 % KMI 7 3/4 01/15/32 GMTN	250	0	0	250 USD	112.56%	281'397.75	0.02	a)
US28370TAG40	4.3000 % KMI 4.3 05/01/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	200	0	0	200 USD	81.40%	162'807.00	0.01	a)
US285512AF68	2.9500 % EA 2.95 02/15/51	0	320	0	320 USD	66.35%	212'324.48	0.01	a)
US28622HAC51	5.1250 % ELV 5 1/8 02/15/53	0	450	0	450 USD	95.09%	427'882.50	0.03	a)
US291011BG86	3.1500 % EMR 3.15 06/01/25	200	0	0	200 USD	97.64%	195'283.60	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US291011BL71	1.8000 % EMR 1.8 10/15/27	500	0	0	500 USD	90.05%	450'227.50	0.03	a)
US291011BQ68	2.0000 % EMR 2 12/21/28	250	0	0	250 USD	88.28%	220'693.00	0.01	a)
US291011BR42	2.2000 % EMR 2.2 12/21/31	500	0	0	500 USD	82.93%	414'640.50	0.03	a)
US291011BS25	2.8000 % EMR 2.8 12/21/51	500	0	0	500 USD	64.37%	321'851.50	0.02	a)
US292480AJ92	5.0000 % ET 5 05/15/44	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US292480AK65	4.4000 % ET 4.4 03/15/27	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US292505AD65	6.5000 % OVV 6 1/2 08/15/34	200	0	0	200 USD	104.43%	208'858.40	0.01	a)
US29250NAJ46	4.5000 % ENBCN 4 1/2 06/10/44	200	0	0	200 USD	83.92%	167'848.20	0.01	a)
US29250NAL91	4.2500 % ENBCN 4 1/4 12/01/26	900	0	0	900 USD	97.63%	878'625.00	0.05	a)
US29250NAM74	5.5000 % ENBCN 5 1/2 12/01/46	300	0	0	300 USD	96.25%	288'750.00	0.02	a)
US29250NAZ87	3.1250 % ENBCN 3 1/8 11/15/29	0	300	0	300 USD	90.18%	270'537.30	0.02	a)
US29250NBE40	3.4000 % ENBCN 3.4 08/01/51	0	290	0	290 USD	70.13%	203'362.50	0.01	a)
US29250NBF15	2.5000 % ENBCN 2 1/2 08/01/33	0	300	0	300 USD	78.75%	236'250.00	0.01	a)
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	0	660	0	660 USD	101.11%	667'316.10	0.04	a)
US29250NBX21	6.0000 % ENBCN 6 11/15/28	0	200	0	200 USD	103.45%	206'891.20	0.01	a)
US29250NBY04	6.2000 % ENBCN 6.2 11/15/30	0	200	0	200 USD	104.69%	209'385.60	0.01	a)
US29250NBZ78	6.7000 % ENBCN 6.7 11/15/53	0	400	0	400 USD	112.21%	448'846.00	0.03	a)
US29250RAW60	5.8750 % ENBCN 5 7/8 10/15/25	0	200	0	200 USD	100.50%	201'002.60	0.01	a)
US29250RAX44	7.3750 % ENBCN 7 3/8 10/15/45	300	0	0	300 USD	115.36%	346'087.50	0.02	a)
US29266MAF68	6.7500 % IBESM 6 3/4 07/15/36	200	0	0	200 USD	111.63%	223'259.40	0.01	a)
US29274FAF18	4.0000 % ENELIM 4 10/25/26	750	0	0	750 USD	95.93%	719'484.00	0.04	a)
US29278DAA37	4.8750 % ENELCH 4 7/8 06/12/28	500	0	0	500 USD	97.25%	486'250.00	0.03	a)
US29359UAB52	4.9500 % ESGR 4.95 06/01/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29364GAJ22	2.9500 % ETR 2.95 09/01/26	250	0	0	250 USD	94.75%	236'872.00	0.01	a)
US29364GAK94	3.7500 % ETR 3 3/4 06/15/50	500	0	0	500 USD	72.49%	362'468.50	0.02	a)
US29364GAP81	2.4000 % ETR 2.4 06/15/31	500	0	0	500 USD	82.32%	411'614.00	0.03	a)
US29364WBA53	4.0000 % ETR 4 03/15/33	0	200	0	200 USD	90.95%	181'906.80	0.01	a)
US29364WBL19	4.7500 % ETR 4 3/4 09/15/52	0	200	0	200 USD	87.95%	175'902.00	0.01	a)
US29365TAK07	1.7500 % ETR 1 3/4 03/15/31	0	200	0	200 USD	80.22%	160'436.20	0.01	a)
US29366MAB46	2.6500 % ETR 2.65 06/15/51	200	0	0	200 USD	60.16%	120'324.60	0.01	a)
US29379VAG86	6.1250 % EPD 6 1/8 10/15/39	550	0	0	550 USD	105.64%	580'995.25	0.04	a)
US29379VAT08	5.9500 % EPD 5.95 02/01/41	250	0	0	250 USD	104.10%	260'252.50	0.02	a)
US29379VAW37	4.8500 % EPD 4.85 08/15/42	800	0	0	800 USD	91.97%	735'728.00	0.05	a)
US29379VAY92	4.4500 % EPD 4.45 02/15/43	70	0	0	70 USD	87.69%	61'384.12	0.00	a)
US29379VBA08	4.8500 % EPD 4.85 03/15/44	250	0	0	250 USD	91.50%	228'744.50	0.01	a)
US29379VBB80	3.9000 % EPD 3.9 02/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29379VBC63	5.1000 % EPD 5.1 02/15/45	250	0	0	250 USD	94.39%	235'979.25	0.01	a)
US29379VBH50	3.7000 % EPD 3.7 02/15/26	250	0	0	250 USD	97.48%	243'702.50	0.02	a)
US29379VBJ17	4.9000 % EPD 4.9 05/15/46	700	0	0	700 USD	91.65%	641'551.40	0.04	a)
US29379VBL62	3.9500 % EPD 3.95 02/15/27	250	0	0	250 USD	97.41%	243'531.00	0.02	a)
US29379VBQ59	4.2500 % EPD 4 1/4 02/15/48	600	0	0	600 USD	83.77%	502'611.60	0.03	a)
US29379VBR33	5.3750 % EPD 5 3/8 02/15/2078	700	0	0	700 USD	92.50%	647'500.00	0.04	a)
US29379VBT98	4.1500 % EPD 4.15 10/16/28	200	0	0	200 USD	96.53%	193'067.40	0.01	a)
US29379VBV45	3.1250 % EPD 3 1/8 07/31/29	0	300	0	300 USD	91.42%	274'250.70	0.02	a)
US29379VBW28	4.2000 % EPD 4.2 01/31/50	0	200	0	200 USD	82.54%	165'073.60	0.01	a)
US29379VBX01	2.8000 % EPD 2.8 01/31/30	0	360	0	360 USD	88.68%	319'257.72	0.02	a)
US29379VBY83	3.7000 % EPD 3.7 01/31/51	0	200	0	200 USD	75.51%	151'018.80	0.01	a)
US29379VBZ58	3.9500 % EPD 3.95 01/31/60	500	0	0	500 USD	75.81%	379'052.00	0.02	a)
US29379VCA98	3.2000 % EPD 3.2 02/15/52	0	300	0	300 USD	68.46%	205'381.20	0.01	a)
US29379VCB71	3.3000 % EPD 3.3 02/15/53	500	0	0	500 USD	69.60%	347'987.50	0.02	a)
US29379VCC54	5.0500 % EPD 5.05 01/10/26	0	200	0	200 USD	99.98%	199'950.60	0.01	a)
US29379VCD38	5.3500 % EPD 5.35 01/31/33	0	500	0	500 USD	101.30%	506'518.50	0.03	a)
US294429AS42	3.1000 % EFX 3.1 05/15/30	0	170	0	170 USD	88.02%	149'632.47	0.01	a)
US294429AT25	2.3500 % EFX 2.35 09/15/31	300	0	0	300 USD	81.47%	244'418.10	0.02	a)
US294429AV70	5.1000 % EFX 5.1 12/15/27	400	0	0	400 USD	99.41%	397'658.40	0.02	a)
US294429AW53	5.1000 % EFX 5.1 06/01/28	0	200	0	200 USD	99.50%	198'998.20	0.01	a)
US29444UBC99	2.6250 % EQIX 2 5/8 11/18/24	200	0	0	200 USD	97.81%	195'616.00	0.01	a)
US29444UBD72	2.9000 % EQIX 2.9 11/18/26	500	0	0	500 USD	94.18%	470'878.00	0.03	a)
US29444UBE55	3.2000 % EQIX 3.2 11/18/29	1'200	0	0	1'200 USD	90.08%	1'080'922.80	0.07	a)
US29444UBF21	1.2500 % EQIX 1 1/4 07/15/25	500	0	0	500 USD	94.32%	471'607.50	0.03	a)
US29444UBH86	2.1500 % EQIX 2.15 07/15/30	400	0	0	400 USD	82.82%	331'265.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US29444UBM71	2.9500 % EQIX 2.95 09/15/51	500	0	0	500 USD	63.49%	317'470.00	0.02	a)
US29444UBT25	3.4000 % EQIX 3.4 02/15/52	0	140	0	140 USD	69.36%	97'098.40	0.01	a)
US29446MAB81	3.6250 % EQNR 3 5/8 09/10/28	500	0	0	500 USD	95.50%	477'500.00	0.03	a)
US29446MAH51	3.7000 % EQNR 3.7 04/06/50	0	360	0	360 USD	77.75%	279'900.00	0.02	a)
US29446MAJ18	1.7500 % EQNR 1 3/4 01/22/26	750	0	0	750 USD	94.00%	705'000.00	0.04	a)
US29452EAC57	5.5940 % EQH 5.594 01/11/33	0	150	0	150 USD	100.76%	151'141.50	0.01	a)
US29670GAD43	2.7040 % WTRG 2.704 04/15/30	200	200	200	200 USD	85.75%	171'490.80	0.01	a)
US29670GAE26	3.3510 % WTRG 3.351 04/15/50	0	200	0	200 USD	68.76%	137'516.20	0.01	a)
US29670GAG73	5.3000 % WTRG 5.3 05/01/52	200	200	200	200 USD	93.41%	186'822.00	0.01	a)
US29717PAP27	3.5000 % ESS 3 1/2 04/01/25	550	0	0	550 USD	97.91%	538'512.70	0.03	a)
US29736RAJ95	3.1500 % EL 3.15 03/15/27	500	0	0	500 USD	95.17%	475'838.00	0.03	a)
US29736RAK68	4.1500 % EL 4.15 03/15/47	500	0	0	500 USD	82.41%	412'034.50	0.03	a)
US29736RAM25	3.1250 % EL 3 1/8 12/01/49	500	0	0	500 USD	68.45%	342'262.00	0.02	a)
US29736RAP55	2.3750 % EL 2 3/8 12/01/29	500	0	0	500 USD	87.33%	436'665.00	0.03	a)
US29736RAS94	4.3750 % EL 4 3/8 05/15/28	0	200	0	200 USD	98.25%	196'501.80	0.01	a)
US29736RAT77	4.6500 % EL 4.65 05/15/33	0	200	0	200 USD	97.23%	194'467.60	0.01	a)
US299808AH86	3.5000 % RE 3 1/2 10/15/50	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US299808AJ43	3.1250 % RE 3 1/8 10/15/52	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30040WAF59	4.2500 % ES 4 1/4 04/01/29 O	550	0	0	550 USD	95.22%	523'696.80	0.03	a)
US30040WAH16	3.4500 % ES 3.45 01/15/50	0	250	0	250 USD	68.43%	171'075.50	0.01	a)
US30040WAK45	1.6500 % ES 1.65 08/15/30 R	0	250	0	250 USD	79.51%	198'786.00	0.01	a)
US30040WAP32	3.3750 % ES 3 3/8 03/01/32	300	0	0	300 USD	85.82%	257'460.00	0.02	a)
US30040WAQ15	2.9000 % ES 2.9 03/01/27	400	0	0	400 USD	93.44%	373'755.60	0.02	a)
US30040WAR97	4.6000 % ES 4.6 07/01/27	200	0	0	200 USD	97.95%	195'892.40	0.01	a)
US30040WAS70	4.2000 % ES 4.2 06/27/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30040WAT53	5.4500 % ES 5.45 03/01/28	0	500	0	500 USD	100.70%	503'514.00	0.03	a)
US30040WAU27	5.1250 % ES 5 1/8 05/15/33	0	300	0	300 USD	96.54%	289'622.40	0.02	a)
US30040WAW82	5.9500 % ES 5.95 02/01/29	0	1'050	0	1'050 USD	102.62%	1'077'545.70	0.07	a)
US30040WAX65	5.5000 % ES 5 1/2 01/01/34	0	200	0	200 USD	98.58%	197'157.80	0.01	a)
US30161MAG87	6.2500 % CEG 6 1/4 10/01/39	350	0	0	350 USD	103.14%	360'980.55	0.02	a)
US30161MAN39	5.6000 % CEG 5.6 06/15/42	150	0	0	150 USD	97.24%	145'858.50	0.01	a)
US30161MAS26	3.2500 % CEG 3 1/4 06/01/25	200	0	0	200 USD	97.21%	194'414.60	0.01	a)
US30161NAC56	5.6250 % EXC 5 5/8 06/15/35	0	200	0	200 USD	99.20%	198'400.00	0.01	a)
US30161NAN12	3.9500 % EXC 3.95 06/15/25	250	0	0	250 USD	98.05%	245'116.75	0.02	a)
US30161NAS09	5.1000 % EXC 5.1 06/15/45	250	0	0	250 USD	91.59%	228'984.75	0.01	a)
US30161NAU54	3.4000 % EXC 3.4 04/15/26	500	0	0	500 USD	96.30%	481'494.00	0.03	a)
US30161NAV38	4.4500 % EXC 4.45 04/15/46	250	0	0	250 USD	83.84%	209'603.00	0.01	a)
US30161NAX93	4.0500 % EXC 4.05 04/15/30	500	0	0	500 USD	93.81%	469'030.50	0.03	a)
US30161NAY76	4.7000 % EXC 4.7 04/15/50	0	200	0	200 USD	86.56%	173'126.00	0.01	a)
US30161NBB64	2.7500 % EXC 2 3/4 03/15/27	0	200	0	200 USD	92.92%	185'835.60	0.01	a)
US30161NBE04	3.3500 % EXC 3.35 03/15/32	0	200	0	200 USD	87.14%	174'281.40	0.01	a)
US30161NBH35	4.1000 % EXC 4.1 03/15/52	0	200	0	200 USD	78.23%	156'460.00	0.01	a)
US30161NBK63	5.3000 % EXC 5.3 03/15/33	0	200	0	200 USD	98.80%	197'601.40	0.01	a)
US30161NBL47	5.6000 % EXC 5.6 03/15/53	0	200	0	200 USD	97.48%	194'968.00	0.01	a)
US30225VAG23	2.3500 % EXR 2.35 03/15/32	0	190	0	190 USD	79.11%	150'317.55	0.01	a)
US30225VAJ61	5.7000 % EXR 5.7 04/01/28	0	155	0	155 USD	101.17%	156'815.52	0.01	a)
US30225VAL18	3.5000 % EXR 3 1/2 07/01/26	0	180	0	180 USD	95.48%	171'870.30	0.01	a)
US30225VAR87	5.9000 % EXR 5.9 01/15/31	0	200	0	200 USD	102.14%	204'286.40	0.01	a)
US30231GAC69	3.1760 % XOM 3.176 03/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30231GAF90	2.7090 % XOM 2.709 03/06/25	700	0	0	700 USD	97.61%	683'258.80	0.04	a)
US30231GAT94	3.0430 % XOM 3.043 03/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.56%	965'566.00	0.06	a)
US30231GAW24	4.1140 % XOM 4.114 03/01/46	700	0	0	700 USD	85.03%	595'231.00	0.04	a)
US30231GAY89	2.9950 % XOM 2.995 08/16/39	500	0	0	500 USD	77.28%	386'386.00	0.02	a)
US30231GBD34	2.2750 % XOM 2.275 08/16/26	1'050	0	0	1'050 USD	94.21%	989'181.90	0.06	a)
US30231GBG64	4.3270 % XOM 4.327 03/19/50	500	0	0	500 USD	86.91%	434'550.00	0.03	a)
US30231GBH48	2.9920 % XOM 2.992 03/19/25	500	0	0	500 USD	97.76%	488'806.00	0.03	a)
US30231GBK76	3.4820 % XOM 3.482 03/19/30	1'000	0	0	1'000 USD	93.17%	931'675.00	0.06	a)
US30231GBM33	3.4520 % XOM 3.452 04/15/51	1'500	0	0	1'500 USD	74.38%	1'115'716.50	0.07	a)
US30231GBN16	2.6100 % XOM 2.61 10/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	87.64%	876'385.00	0.05	a)
US302491AT29	3.2000 % FMC 3.2 10/01/26	500	0	0	500 USD	93.33%	466'666.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US302491AU91	3.4500 % FMC 3.45 10/01/29	0	150	0	150 USD	88.53%	132'796.95	0.01	a)
US302491AV74	4.5000 % FMC 4 1/2 10/01/49	0	250	0	250 USD	74.40%	186'007.00	0.01	a)
US302491AX31	5.6500 % FMC 5.65 05/18/33	0	250	0	250 USD	96.58%	241'450.50	0.02	a)
US302491AY14	6.3750 % FMC 6 3/8 05/18/53	0	250	0	250 USD	97.86%	244'648.50	0.02	a)
US302635AG21	3.4000 % FSK 3.4 01/15/26	500	0	0	500 USD	94.42%	472'095.00	0.03	a)
US302635AL16	3.2500 % FSK 3 1/4 07/15/27	500	0	0	500 USD	90.86%	454'304.00	0.03	a)
US30303M8G02	3.5000 % META 3 1/2 08/15/27	0	770	770	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8H84	3.8500 % META 3.85 08/15/32	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8J41	4.4500 % META 4.45 08/15/52	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8K14	4.6500 % META 4.65 08/15/62	0	440	440	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8L96	4.6000 % META 4.6 05/15/28	0	450	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8M79	4.8000 % META 4.8 05/15/30	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8N52	4.9500 % META 4.95 05/15/33	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8Q83	5.6000 % META 5.6 05/15/53	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30303M8R66	5.7500 % META 5 3/4 05/15/63	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US303075AB13	3.4500 % FDS 3.45 03/01/32	0	200	0	200 USD	86.88%	173'769.60	0.01	a)
US313747AV99	4.5000 % FRT 4 1/2 12/01/44	0	350	0	350 USD	81.42%	284'956.35	0.02	a)
US31428XAT37	3.8750 % FDX 3 7/8 08/01/42	250	0	0	250 USD	79.19%	197'974.25	0.01	a)
US31428XAU00	4.1000 % FDX 4.1 04/15/43	0	100	0	100 USD	81.71%	81'712.30	0.01	a)
US31428XAW65	5.1000 % FDX 5.1 01/15/44	150	100	0	250 USD	92.84%	232'105.25	0.01	a)
US31428XAX49	4.9000 % FDX 4.9 01/15/34	500	0	0	500 USD	97.06%	485'281.00	0.03	a)
US31428XBA37	3.9000 % FDX 3.9 02/01/35	250	0	0	250 USD	88.17%	220'429.00	0.01	a)
US31428XBB10	4.1000 % FDX 4.1 02/01/45	200	0	0	200 USD	80.16%	160'315.40	0.01	a)
US31428XBE58	4.7500 % FDX 4 3/4 11/15/45	500	0	0	500 USD	87.98%	439'901.00	0.03	a)
US31428XBF24	3.2500 % FDX 3 1/4 04/01/26	500	0	0	500 USD	96.44%	482'185.50	0.03	a)
US31428XBG07	4.5500 % FDX 4.55 04/01/46	300	0	0	300 USD	84.97%	254'911.20	0.02	a)
US31428XBH57	4.4000 % FDX 4.4 01/15/47	200	0	0	200 USD	83.02%	166'044.80	0.01	a)
US31428XBP06	3.4000 % FDX 3.4 02/15/28	0	200	0	200 USD	94.62%	189'249.60	0.01	a)
US31428XBQ88	4.0500 % FDX 4.05 02/15/48	0	300	0	300 USD	78.88%	236'636.40	0.01	a)
US31428XBS45	4.9500 % FDX 4.95 10/17/48	0	250	0	250 USD	90.75%	226'868.00	0.01	a)
US31428XBV73	3.1000 % FDX 3.1 08/05/29	0	250	0	250 USD	90.86%	227'140.50	0.01	a)
US31428XBZ87	4.2500 % FDX 4 1/4 05/15/30	500	0	0	500 USD	95.36%	476'795.50	0.03	a)
US31428XCA28	5.2500 % FDX 5 1/4 05/15/50	500	0	0	500 USD	94.23%	471'149.50	0.03	a)
US31428XCE40	3.2500 % FDX 3 1/4 05/15/41	0	100	0	100 USD	73.98%	73'980.20	0.00	a)
US31572UAF30	5.5000 % SUZANO 5 1/2 01/17/27	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31620MBJ45	3.7500 % FIS 3 3/4 05/21/29	0	150	0	150 USD	95.25%	142'876.95	0.01	a)
US31620MBR60	1.1500 % FIS 1.15 03/01/26	500	0	0	500 USD	92.50%	462'515.50	0.03	a)
US31620MBS44	1.6500 % FIS 1.65 03/01/28	500	0	0	500 USD	88.04%	440'189.50	0.03	a)
US31620MBU99	3.1000 % FIS 3.1 03/01/41	0	250	0	250 USD	71.90%	179'760.00	0.01	a)
US31620MBW55	4.7000 % FIS 4.7 07/15/27	0	150	0	150 USD	99.06%	148'586.55	0.01	a)
US31620MBY12	5.1000 % FIS 5.1 07/15/32	500	0	0	500 USD	99.76%	498'818.00	0.03	a)
US31620MBZ86	5.6250 % FIS 5 5/8 07/15/52	400	100	0	500 USD	98.87%	494'372.00	0.03	a)
US316773CH12	8.2500 % FITB 8 1/4 03/01/38	500	0	0	500 USD	118.19%	590'950.50	0.04	a)
US316773CX61	3.6500 % FITB 3.65 01/25/24	1'150	0	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US316773DA59	2.5500 % FITB 2.55 05/05/27	500	0	0	500 USD	92.09%	460'447.00	0.03	a)
US316773DF47	4.3370 % FITB 4.337 04/25/33	0	150	0	150 USD	90.53%	135'792.90	0.01	a)
US316773DG20	4.7720 % FITB 4.772 07/28/30	0	250	0	250 USD	94.93%	237'312.50	0.01	a)
US316773DJ68	6.3610 % FITB 6.361 10/27/28	500	0	0	500 USD	101.51%	507'544.50	0.03	a)
US316773DK32	6.3390 % FITB 6.339 07/27/29	0	200	0	200 USD	102.71%	205'413.00	0.01	a)
US316773DL15	5.6310 % FITB 5.631 01/29/32	0	300	0	300 USD	98.90%	296'702.10	0.02	a)
US316773BQ06	3.9500 % FITB 3.95 07/28/25 BKNT	0	250	0	250 USD	97.76%	244'390.75	0.02	a)
US337738AP30	3.8500 % FI 3.85 06/01/25	1'000	0	0	1'000 USD	98.00%	979'987.00	0.06	a)
US337738AT51	3.2000 % FI 3.2 07/01/26	500	150	0	650 USD	95.60%	621'402.60	0.04	a)
US337738AU25	3.5000 % FI 3 1/2 07/01/29	940	0	0	940 USD	91.78%	862'744.22	0.05	a)
US337738AV08	4.4000 % FI 4.4 07/01/49	500	0	0	500 USD	83.45%	417'251.50	0.03	a)
US337738BB35	2.2500 % FI 2 1/4 06/01/27	400	0	0	400 USD	91.54%	366'166.40	0.02	a)
US337738BD90	5.4500 % FI 5.45 03/02/28	0	350	0	350 USD	100.70%	352'465.05	0.02	a)
US337738BE73	5.6000 % FI 5.6 03/02/33	0	500	0	500 USD	100.55%	502'731.00	0.03	a)
US337738BG22	5.3750 % FI 5 3/8 08/21/28	0	250	0	250 USD	100.84%	252'103.00	0.02	a)
US337738BH05	5.6250 % FI 5 5/8 08/21/33	0	450	0	450 USD	100.88%	453'955.50	0.03	a)
US33830GAA94	5.7910 % PRU 5.791 02/15/33	0	234	0	234 USD	102.70%	240'325.25	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 USD	in % 7)	Kat.
US33938XAA37	4.8750 % FLEX 4 7/8 06/15/29	0	190	0	190 USD	97.14%	184'569.80	0.01	a)
US33938XAB10	4.8750 % FLEX 4 7/8 05/12/30	250	0	0	250 USD	96.27%	240'682.00	0.02	a)
US33938XAC92	3.7500 % FLEX 3 3/4 02/01/26	250	0	0	250 USD	96.80%	242'006.50	0.02	a)
US341081FA03	5.9500 % NEE 5.95 02/01/38	0	200	0	200 USD	106.40%	212'805.60	0.01	a)
US341081FF99	4.1250 % NEE 4 1/8 02/01/42	500	0	0	500 USD	86.33%	431'656.50	0.03	a)
US341081FL67	4.0500 % NEE 4.05 10/01/44	250	0	0	250 USD	83.99%	209'985.25	0.01	a)
US341081FM41	3.1250 % NEE 3 1/8 12/01/25	300	0	0	300 USD	97.00%	291'000.00	0.02	a)
US341081FP71	3.7000 % NEE 3.7 12/01/47	300	0	0	300 USD	77.88%	233'629.80	0.01	a)
US341081FU66	3.9900 % NEE 3.99 03/01/49	500	0	0	500 USD	81.37%	406'872.50	0.03	a)
US341081GE16	2.8750 % NEE 2 7/8 12/04/51	0	200	0	200 USD	65.15%	130'309.60	0.01	a)
US341099CH09	6.3500 % DUK 6.35 09/15/37	120	0	0	120 USD	107.39%	128'863.44	0.01	a)
US341099CL11	6.4000 % DUK 6.4 06/15/38	600	0	0	600 USD	107.84%	647'023.80	0.04	a)
US343498AC58	2.4000 % FLO 2.4 03/15/31	0	150	0	150 USD	83.28%	124'915.35	0.01	a)
US34355JAB44	2.8000 % FLS 2.8 01/15/32	250	0	0	250 USD	81.31%	203'285.00	0.01	a)
US344419AB20	4.3750 % FEMSA 4 3/8 05/10/43	300	160	460	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US344419AC03	3.5000 % FEMSA 3 1/2 01/16/50	0	600	0	600 USD	72.48%	434'904.60	0.03	a)
US345370CA64	7.4500 % F 7.45 07/16/31	0	300	0	300 USD	107.90%	323'709.60	0.02	a)
US345370CQ17	4.7500 % F 4 3/4 01/15/43	0	600	0	600 USD	80.92%	485'526.60	0.03	a)
US345370CR99	4.3460 % F 4.346 12/08/26	0	450	0	450 USD	97.04%	436'684.05	0.03	a)
US345370CS72	5.2910 % F 5.291 12/08/46	0	400	0	400 USD	86.25%	344'992.00	0.02	a)
US345370DA55	3.2500 % F 3 1/4 02/12/32	0	750	0	750 USD	82.05%	615'355.50	0.04	a)
US345370DB39	6.1000 % F 6.1 08/19/32	0	550	0	550 USD	99.89%	549'391.70	0.03	a)
US345397A456	4.2710 % F 4.271 01/09/27	0	250	0	250 USD	95.90%	239'744.75	0.01	a)
US345397A605	5.1250 % F 5 1/8 06/16/25	0	550	0	550 USD	99.02%	544'583.05	0.03	a)
US345397A860	4.1250 % F 4 1/8 08/17/27	0	400	0	400 USD	94.62%	378'477.60	0.02	a)
US345397B280	3.3750 % F 3 3/8 11/13/25	0	650	0	650 USD	95.77%	622'476.40	0.04	a)
US345397B363	4.0000 % F 4 11/13/30	0	500	0	500 USD	88.42%	442'094.00	0.03	a)
US345397B512	2.9000 % F 2.9 02/16/28	0	250	0	250 USD	89.77%	224'432.25	0.01	a)
US345397B694	3.6250 % F 3 5/8 06/17/31	0	300	0	300 USD	86.69%	260'081.10	0.02	a)
US345397B777	2.7000 % F 2.7 08/10/26	0	450	0	450 USD	92.79%	417'567.15	0.03	a)
US345397B934	2.9000 % F 2.9 02/10/29	0	250	0	250 USD	87.31%	218'278.75	0.01	a)
US345397C270	4.9500 % F 4.95 05/28/27	0	450	0	450 USD	97.18%	437'320.80	0.03	a)
US345397C353	7.3500 % F 7.35 11/04/27	0	450	0	450 USD	104.07%	468'326.70	0.03	a)
US345397C437	6.9500 % F 6.95 03/06/26	0	400	0	400 USD	101.76%	407'046.00	0.03	a)
US345397C684	7.3500 % F 7.35 03/06/30	0	350	0	350 USD	105.45%	369'077.45	0.02	a)
US345397C924	6.8000 % F 6.8 05/12/28	0	450	0	450 USD	103.17%	464'273.55	0.03	a)
US345397D260	6.9500 % F 6.95 06/10/26	0	250	0	250 USD	102.04%	255'098.50	0.02	a)
US345397D427	7.2000 % F 7.2 06/10/30	0	250	0	250 USD	105.22%	263'046.75	0.02	a)
US345397D591	6.7980 % F 6.798 11/07/28	0	450	0	450 USD	103.72%	466'734.60	0.03	a)
US345397D674	7.1220 % F 7.122 11/07/33	0	400	0	400 USD	106.72%	426'888.40	0.03	a)
US345397D831	5.8000 % F 5.8 03/05/27	0	450	0	450 USD	99.39%	447'234.30	0.03	a)
US345397E250	6.0500 % F 6.05 03/05/31	0	300	0	300 USD	99.17%	297'505.50	0.02	a)
US345397XL24	4.1340 % F 4.134 08/04/25	0	400	0	400 USD	97.40%	389'591.20	0.02	a)
US345397XU23	4.3890 % F 4.389 01/08/26 GMTN	0	350	0	350 USD	97.16%	340'063.15	0.02	a)
US345397YT41	3.8150 % F 3.815 11/02/27	0	250	0	250 USD	93.08%	232'704.75	0.01	a)
US345397ZR75	5.1130 % F 5.113 05/03/29	0	450	0	450 USD	95.85%	431'339.40	0.03	a)
US345397ZW60	4.5420 % F 4.542 08/01/26	0	250	0	250 USD	96.95%	242'375.00	0.02	a)
US349553AM97	3.0550 % FTSCN 3.055 10/04/26	310	0	0	310 USD	94.35%	292'498.02	0.02	a)
US34959EAA73	1.0000 % FTNT 1 03/15/26	200	0	0	200 USD	91.63%	183'257.40	0.01	a)
US34959EAB56	2.2000 % FTNT 2.2 03/15/31	0	146	0	146 USD	82.38%	120'267.50	0.01	a)
US34959JAG31	3.1500 % FTV 3.15 06/15/26	250	0	0	250 USD	95.28%	238'193.25	0.01	a)
US34959JAH14	4.3000 % FTV 4.3 06/15/46	0	250	0	250 USD	81.50%	203'747.00	0.01	a)
US34964CAA45	4.0000 % FBINUS 4 06/15/25	400	0	0	400 USD	97.94%	391'756.40	0.02	a)
US34964CAE66	3.2500 % FBINUS 3 1/4 09/15/29	0	200	0	200 USD	90.49%	180'972.60	0.01	a)
US34964CAH97	5.8750 % FBINUS 5 7/8 06/01/33	0	200	0	200 USD	101.30%	202'609.40	0.01	a)
US35137LAG05	4.0300 % FOXA 4.03 01/25/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US35137LAH87	4.7090 % FOXA 4.709 01/25/29	500	0	0	500 USD	97.54%	487'691.00	0.03	a)
US35137LAJ44	5.4760 % FOXA 5.476 01/25/39	500	0	0	500 USD	93.04%	465'220.50	0.03	a)
US35137LAK17	5.5760 % FOXA 5.576 01/25/49	0	350	0	350 USD	91.88%	321'572.30	0.02	a)
US35137LAL99	3.5000 % FOXA 3 1/2 04/08/30	1'000	0	0	1'000 USD	89.86%	898'618.00	0.06	a)
US35137LAM72	3.0500 % FOXA 3.05 04/07/25	0	1'000	0	1'000 USD	97.26%	972'629.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US35137LAN55	6.5000 % FOXA 6 1/2 10/13/33	0	500	0	500 USD	104.78%	523'887.50	0.03	a)
US35177PAL13	9.0000 % ORAFP 8 1/2 03/01/31	670	0	0	670 USD	120.84%	809'598.52	0.05	a)
US35177PAX50	5.3750 % ORAFP 5 3/8 01/13/42	80	500	0	580 USD	98.58%	571'787.20	0.04	a)
US35671DBC83	5.4500 % FCX 5.45 03/15/43	500	450	0	950 USD	92.88%	882'312.50	0.06	a)
US35671DBL82	4.5500 % FCX 4.55 11/14/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US35671DCH61	4.6250 % FCX 4 5/8 08/01/30	500	300	0	800 USD	95.00%	760'000.00	0.05	a)
US361448BF99	4.0000 % GMT 4 06/30/30	300	0	0	300 USD	92.87%	278'606.10	0.02	a)
US361448BH55	3.1000 % GMT 3.1 06/01/51	300	0	0	300 USD	64.25%	192'753.30	0.01	a)
US36164QNA21	4.4180 % GE 4.418 11/15/35	3'250	0	0	3'250 USD	93.47%	3'037'612.50	0.19	a)
US36186C8Y84	8.0000 % ALLY 8 11/01/31	0	500	0	500 USD	109.73%	548'634.50	0.03	a)
US36264FAK75	3.3750 % HLNLN 3 3/8 03/24/27	750	0	0	750 USD	94.84%	711'318.00	0.04	a)
US36264FAM32	3.6250 % HLNLN 3 5/8 03/24/32	1'000	0	0	1'000 USD	89.92%	899'249.00	0.06	a)
US36264FAN15	4.0000 % HLNLN 4 03/24/52	500	0	0	500 USD	79.92%	399'597.50	0.02	a)
US36264NAB01	3.1250 % HLNLN 3 1/8 03/24/25	500	0	0	500 USD	97.64%	488'212.50	0.03	a)
US36267VAA17	5.5500 % GEHC 5.55 11/15/24 144A	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAB99	5.5500 % GEHC 5.55 11/15/24	0	300	0	300 USD	99.87%	299'610.00	0.02	a)
US36267VAC72	5.6000 % GEHC 5.6 11/15/25 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAD55	5.6000 % GEHC 5.6 11/15/25	0	400	0	400 USD	100.34%	401'348.80	0.03	a)
US36267VAE39	5.6500 % GEHC 5.65 11/15/27 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAF04	5.6500 % GEHC 5.65 11/15/27	0	500	0	500 USD	101.43%	507'143.00	0.03	a)
US36267VAG86	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30 144A	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAH69	5.8570 % GEHC 5.857 03/15/30	0	400	0	400 USD	103.17%	412'660.00	0.03	a)
US36267VAJ26	5.9050 % GEHC 5.905 11/22/32 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAK98	5.9050 % GEHC 5.905 11/22/32	0	500	0	500 USD	104.00%	519'991.00	0.03	a)
US36267VAL71	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US36267VAM54	6.3770 % GEHC 6.377 11/22/52	0	600	0	600 USD	110.52%	663'097.80	0.04	a)
US36962G3P70	5.8750 % GE 5 7/8 01/14/38 MTN	800	0	0	800 USD	105.85%	846'799.20	0.05	a)
US36962G4B75	6.8750 % GE 6 7/8 01/10/39 GMTN	660	0	0	660 USD	117.52%	775'659.06	0.05	a)
US36962GXZ26	6.7500 % GE 6 3/4 03/15/32 MTNA	900	0	0	900 USD	110.76%	996'842.70	0.06	a)
US370334BT00	3.6500 % GIS 3.65 02/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US370334BZ69	3.2000 % GIS 3.2 02/10/27	300	0	0	300 USD	95.11%	285'323.40	0.02	a)
US370334CG79	4.2000 % GIS 4.2 04/17/28	1'000	0	0	1'000 USD	97.14%	971'352.00	0.06	a)
US370334CP78	3.0000 % GIS 3 02/01/51	100	0	0	100 USD	65.08%	65'075.70	0.00	a)
US370334CQ51	2.2500 % GIS 2 1/4 10/14/31	0	150	0	150 USD	81.83%	122'737.65	0.01	a)
US370334CS18	5.2410 % GIS 5.241 11/18/25	300	0	0	300 USD	99.69%	299'078.10	0.02	a)
US370334CT90	4.9500 % GIS 4.95 03/29/33	0	290	0	290 USD	97.91%	283'928.85	0.02	a)
US370334CW20	5.5000 % GIS 5 1/2 10/17/28	0	150	0	150 USD	101.83%	152'742.60	0.01	a)
US37045VAF76	6.2500 % GM 6 1/4 10/02/43	500	0	0	500 USD	100.47%	502'326.50	0.03	a)
US37045VAG59	4.0000 % GM 4 04/01/25	200	0	0	200 USD	98.44%	196'871.60	0.01	a)
US37045VAH33	5.0000 % GM 5 04/01/35	350	0	0	350 USD	93.27%	326'446.05	0.02	a)
US37045VAJ98	5.2000 % GM 5.2 04/01/45	200	0	0	200 USD	87.84%	175'674.00	0.01	a)
US37045VAK61	6.6000 % GM 6.6 04/01/36	450	0	0	450 USD	104.94%	472'208.85	0.03	a)
US37045VAL45	6.7500 % GM 6 3/4 04/01/46	0	300	0	300 USD	105.72%	317'164.20	0.02	a)
US37045VAN01	4.2000 % GM 4.2 10/01/27	750	0	0	750 USD	96.43%	723'235.50	0.05	a)
US37045VAP58	5.1500 % GM 5.15 04/01/38	500	0	0	500 USD	92.94%	464'706.00	0.03	a)
US37045VAQ32	5.4000 % GM 5.4 04/01/48	750	0	0	750 USD	89.08%	668'102.25	0.04	a)
US37045VAS97	5.0000 % GM 5 10/01/28	500	0	0	500 USD	99.37%	496'830.50	0.03	a)
US37045VAT70	5.9500 % GM 5.95 04/01/49	0	300	0	300 USD	95.63%	286'880.10	0.02	a)
US37045VAV27	6.1250 % GM 6 1/8 10/01/25	500	0	0	500 USD	100.80%	504'005.50	0.03	a)
US37045VAY65	5.4000 % GM 5.4 10/15/29	0	300	0	300 USD	99.71%	299'118.00	0.02	a)
US37045VAZ31	5.6000 % GM 5.6 10/15/32	0	500	0	500 USD	99.35%	496'761.50	0.03	a)
US37045XAS53	4.0000 % GM 4 01/15/25	100	0	0	100 USD	98.57%	98'571.00	0.01	a)
US37045XAZ96	4.3000 % GM 4.3 07/13/25	500	0	0	500 USD	98.36%	491'794.50	0.03	a)
US37045XBG07	5.2500 % GM 5 1/4 03/01/26	850	0	0	850 USD	99.53%	846'005.00	0.05	a)
US37045XBQ88	4.0000 % GM 4 10/06/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.53%	965'343.00	0.06	a)
US37045XBT28	4.3500 % GM 4.35 01/17/27	300	150	0	450 USD	96.99%	436'457.25	0.03	a)
US37045XBW56	3.9500 % GM 3.95 04/13/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XCD66	3.5000 % GM 3 1/2 11/07/24	500	0	0	500 USD	98.49%	492'445.00	0.03	a)
US37045XCK00	4.3500 % GM 4.35 04/09/25	500	0	0	500 USD	98.71%	493'539.50	0.03	a)
US37045XCR52	5.1000 % GM 5.1 01/17/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XCX04	3.6000 % GM 3.6 06/21/30	500	0	0	500 USD	89.35%	446'761.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US37045XDE31	2.3500 % GM 2.35 01/08/31	400	0	0	400 USD	81.57%	326'299.60	0.02	a)
US37045XDG88	1.0500 % GM 1.05 03/08/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XDL73	2.7000 % GM 2.7 06/10/31	500	0	0	500 USD	82.47%	412'372.00	0.03	a)
US37045XDS27	3.1000 % GM 3.1 01/12/32	0	250	0	250 USD	83.37%	208'423.00	0.01	a)
US37045XDV55	4.3000 % GM 4.3 04/06/29	0	400	0	400 USD	94.68%	378'731.60	0.02	a)
US37045XDW39	5.0000 % GM 5 04/09/27	500	0	0	500 USD	98.86%	494'314.50	0.03	a)
US37045XDZ69	6.0500 % GM 6.05 10/10/25	0	300	0	300 USD	100.64%	301'929.60	0.02	a)
US37045XE82	6.0000 % GM 6 01/09/28	0	500	0	500 USD	101.89%	509'448.00	0.03	a)
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	0	400	0	400 USD	103.62%	414'478.80	0.03	a)
US37045XEG79	5.8500 % GM 5.85 04/06/30	0	250	0	250 USD	101.46%	253'656.25	0.02	a)
US37045XEHS2	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	0	400	0	400 USD	101.53%	406'128.80	0.03	a)
US37045XEN21	5.8000 % GM 5.8 01/07/29	0	500	0	500 USD	101.09%	505'462.00	0.03	a)
US37045XEP78	6.1000 % GM 6.1 01/07/34	0	500	0	500 USD	100.99%	504'939.50	0.03	a)
US372460AB11	1.7500 % GPC 1 3/4 02/01/25	500	0	0	500 USD	96.46%	482'315.00	0.03	a)
US372460AC93	2.7500 % GPC 2 3/4 02/01/32	0	200	0	200 USD	82.21%	164'427.00	0.01	a)
US373298BR83	7.7500 % GP 7 3/4 11/15/29	250	0	0	250 USD	113.65%	284'115.25	0.02	a)
US375558AS26	5.6500 % GILD 5.65 12/01/41	750	0	0	750 USD	101.63%	762'213.00	0.05	a)
US375558AW38	3.7000 % GILD 3.7 04/01/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US375558AX11	4.8000 % GILD 4.8 04/01/44	500	0	0	500 USD	92.60%	463'008.00	0.03	a)
US375558AZ68	3.5000 % GILD 3 1/2 02/01/25	400	0	0	400 USD	98.26%	393'055.20	0.02	a)
US375558BA09	4.5000 % GILD 4 1/2 02/01/45	500	0	0	500 USD	88.61%	443'039.00	0.03	a)
US375558BD48	4.7500 % GILD 4 3/4 03/01/46	500	200	0	700 USD	91.43%	640'022.60	0.04	a)
US375558BF95	3.6500 % GILD 3.65 03/01/26	1'000	0	0	1'000 USD	97.05%	970'512.00	0.06	a)
US375558BG78	4.6000 % GILD 4.6 09/01/35	500	0	0	500 USD	94.82%	474'095.00	0.03	a)
US375558BJ18	4.0000 % GILD 4 09/01/36	250	0	0	250 USD	88.91%	222'285.25	0.01	a)
US375558BK80	4.1500 % GILD 4.15 03/01/47	550	0	0	550 USD	83.10%	457'056.05	0.03	a)
US375558BM47	2.9500 % GILD 2.95 03/01/27	500	0	0	500 USD	94.48%	472'402.50	0.03	a)
US375558BS17	2.6000 % GILD 2.6 10/01/40	0	300	0	300 USD	69.83%	209'477.70	0.01	a)
US375558BT99	2.8000 % GILD 2.8 10/01/50	250	100	0	350 USD	64.81%	226'832.90	0.01	a)
US375558BZ59	5.2500 % GILD 5 1/4 10/15/33	0	300	0	300 USD	101.07%	303'201.60	0.02	a)
US375558CA99	5.5500 % GILD 5.55 10/15/53	0	500	0	500 USD	102.11%	510'556.50	0.03	a)
US377372AE71	6.3750 % GSK 6 3/8 05/15/38	790	0	0	790 USD	112.14%	885'887.83	0.06	a)
US377372AJ68	4.2000 % GSK 4.2 03/18/43	200	0	0	200 USD	87.82%	175'649.00	0.01	a)
US377372AM97	3.6250 % GSK 3 5/8 05/15/25	500	0	0	500 USD	98.26%	491'306.00	0.03	a)
US377372AN70	3.8750 % GSK 3 7/8 05/15/28	500	0	0	500 USD	96.66%	483'282.50	0.03	a)
US377373AH85	3.3750 % GSK 3 3/8 06/01/29	500	0	0	500 USD	93.94%	469'707.50	0.03	a)
US37940XAB82	3.2000 % GPN 3.2 08/15/29	0	380	0	380 USD	89.30%	339'357.86	0.02	a)
US37940XAC65	4.1500 % GPN 4.15 08/15/49	0	350	0	350 USD	76.30%	267'038.10	0.02	a)
US37940XAD49	2.9000 % GPN 2.9 05/15/30	0	300	0	300 USD	86.00%	258'011.10	0.02	a)
US37940XAE22	1.2000 % GPN 1.2 03/01/26	0	400	0	400 USD	92.05%	368'193.20	0.02	a)
US37940XAG79	2.1500 % GPN 2.15 01/15/27	0	200	0	200 USD	91.69%	183'385.80	0.01	a)
US37940XAN21	5.3000 % GPN 5.3 08/15/29	0	300	0	300 USD	98.36%	295'092.30	0.02	a)
US37940XAP78	4.9500 % GPN 4.95 08/15/27	0	300	0	300 USD	99.19%	297'571.20	0.02	a)
US37940XAQ51	5.4000 % GPN 5.4 08/15/32	0	400	0	400 USD	98.64%	394'568.00	0.02	a)
US37940XAR35	5.9500 % GPN 5.95 08/15/52	0	350	0	350 USD	97.96%	342'851.60	0.02	a)
US38141EC238	3.8500 % GS 3.85 07/08/24 MTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141EC311	4.8000 % GS 4.8 07/08/44 MTN	400	200	0	600 USD	91.32%	547'920.00	0.03	a)
US38141GA468	6.4840 % GS 6.484 10/24/29	0	1'215	0	1'215 USD	104.43%	1'268'848.80	0.08	a)
US38141GA534	6.5610 % GS 6.561 10/24/34	0	620	0	620 USD	108.36%	671'826.42	0.04	a)
US38141GE593	5.9500 % GS 5.95 01/15/27	350	0	0	350 USD	102.15%	357'517.30	0.02	a)
US38141GFD16	6.7500 % GS 6 3/4 10/01/37	1'590	0	0	1'590 USD	109.07%	1'734'144.63	0.11	a)
US38141GGM06	6.2500 % GS 6 1/4 02/01/41	950	0	0	950 USD	108.28%	1'028'617.25	0.06	a)
US38141GVM31	4.0000 % GS 4 03/03/24	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GVR28	4.2500 % GS 4 1/4 10/21/25	750	0	0	750 USD	98.94%	742'041.75	0.05	a)
US38141GV501	4.7500 % GS 4 3/4 10/21/45	400	200	0	600 USD	91.56%	549'365.40	0.03	a)
US38141GW866	3.8500 % GS 3.85 01/26/27	1'400	0	0	1'400 USD	96.56%	1'351'771.40	0.08	a)
US38141GWL49	3.6910 % GS 3.691 06/05/28	500	0	0	500 USD	95.56%	477'802.50	0.03	a)
US38141GWQ36	3.2720 % GS 3.272 09/29/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GWV21	3.8140 % GS 3.814 04/23/29	1'750	400	0	2'150 USD	94.62%	2'034'375.15	0.13	a)
US38141GWZ35	4.2230 % GS 4.223 05/01/29	500	0	0	500 USD	95.46%	477'295.50	0.03	a)
US38141GXA74	4.4110 % GS 4.411 04/23/39	0	800	0	800 USD	88.88%	711'059.20	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 USD	in % 7)	Kat.
US38141GXG45	2.6000 % GS 2.6 02/07/30	450	0	0	450 USD	86.95%	391'263.75	0.02	a)
US38141GXH28	3.8000 % GS 3.8 03/15/30	500	0	0	500 USD	92.83%	464'135.00	0.03	a)
US38141GXJ83	3.5000 % GS 3 1/2 04/01/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.88%	978'816.00	0.06	a)
US38141GXR00	1.9920 % GS 1.992 01/27/32	1'000	0	0	1'000 USD	79.69%	796'853.00	0.05	a)
US38141GXS82	0.8550 % GS 0.855 02/12/26	500	0	0	500 USD	95.41%	477'042.50	0.03	a)
US38141GYA65	1.4310 % GS 1.431 03/09/27	0	500	0	500 USD	91.93%	459'671.50	0.03	a)
US38141GYB49	2.6150 % GS 2.615 04/22/32	1'000	0	0	1'000 USD	82.61%	826'108.00	0.05	a)
US38141GYC22	3.2100 % GS 3.21 04/22/42	0	800	0	800 USD	74.42%	595'379.20	0.04	a)
US38141GYG36	1.5420 % GS 1.542 09/10/27	1'000	0	0	1'000 USD	91.06%	910'636.00	0.06	a)
US38141GYJ74	2.3830 % GS 2.383 07/21/32	1'000	0	0	1'000 USD	81.42%	814'237.00	0.05	a)
US38141GYK48	2.9080 % GS 2.908 07/21/42	500	0	0	500 USD	70.79%	353'945.00	0.02	a)
US38141GYM04	1.9480 % GS 1.948 10/21/27	1'250	0	0	1'250 USD	91.57%	1'144'568.75	0.07	a)
US38141GYN86	2.6500 % GS 2.65 10/21/32	1'000	0	0	1'000 USD	82.43%	824'301.00	0.05	a)
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	0	750	0	750 USD	92.69%	695'178.75	0.04	a)
US38141GZM94	3.1020 % GS 3.102 02/24/33	1'250	250	0	1'500 USD	84.50%	1'267'461.00	0.08	a)
US38141GZN77	3.4360 % GS 3.436 02/24/43	500	200	0	700 USD	75.73%	530'141.50	0.03	a)
US38141GZP26	3.0000 % GS 3 03/15/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GZR81	3.6150 % GS 3.615 03/15/28	800	0	0	800 USD	94.93%	759'470.40	0.05	a)
US38141GZU11	4.4820 % GS 4.482 08/23/28	0	400	0	400 USD	97.69%	390'745.60	0.02	a)
US38143U8H71	3.7500 % GS 3 3/4 02/25/26	450	0	0	450 USD	97.28%	437'770.35	0.03	a)
US38143YAC75	6.4500 % GS 6.45 05/01/36	250	0	0	250 USD	105.91%	264'785.50	0.02	a)
US38145GAH39	3.5000 % GS 3 1/2 11/16/26	1'150	0	0	1'150 USD	95.92%	1'103'060.45	0.07	a)
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	0	650	0	650 USD	100.54%	653'526.90	0.04	a)
US38147UAD90	2.8750 % GSBD 2 7/8 01/15/26	400	0	0	400 USD	95.14%	380'570.40	0.02	a)
US38148LAC00	3.5000 % GS 3 1/2 01/23/25	1'200	0	0	1'200 USD	98.26%	1'179'120.00	0.07	a)
US38148LAE65	3.7500 % GS 3 3/4 05/22/25	750	0	0	750 USD	98.01%	735'045.00	0.05	a)
US38148LAF31	5.1500 % GS 5.15 05/22/45	700	0	0	700 USD	95.97%	671'818.00	0.04	a)
US38148YAA64	4.0170 % GS 4.017 10/31/38	0	800	0	800 USD	84.72%	677'762.40	0.04	a)
US38173MAA09	3.3750 % GBDC 3 3/8 04/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38173MAB81	2.5000 % GBDC 2 1/2 08/24/26	250	0	0	250 USD	91.16%	227'894.50	0.01	a)
US384802AB05	4.6000 % GWW 4.6 06/15/45	350	0	0	350 USD	90.87%	318'039.40	0.02	a)
US384802AE44	1.8500 % GWW 1.85 02/15/25	200	0	0	200 USD	96.74%	193'486.20	0.01	a)
US40049JAZ03	6.6250 % TELVIS 6 5/8 01/15/40	260	0	0	260 USD	102.43%	266'315.66	0.02	a)
US40049JBA43	5.0000 % TELVIS 5 05/13/45	750	0	0	750 USD	82.94%	622'023.00	0.04	a)
US40049JBC09	6.1250 % TELVIS 6 1/8 01/31/46	200	0	0	200 USD	96.27%	192'545.80	0.01	a)
US403949AB64	5.8750 % DINO 5 7/8 04/01/26	0	400	0	400 USD	100.33%	401'334.40	0.03	a)
US404119BT57	5.2500 % HCA 5 1/4 06/15/26	0	450	0	450 USD	99.38%	447'187.50	0.03	a)
US404119BU21	4.5000 % HCA 4 1/2 02/15/27	0	500	0	500 USD	97.75%	488'750.00	0.03	a)
US404119BV04	5.5000 % HCA 5 1/2 06/15/47	0	500	0	500 USD	93.13%	465'625.00	0.03	a)
US404119BW86	5.8750 % HCA 5 7/8 02/01/29	0	300	0	300 USD	101.75%	305'250.00	0.02	a)
US404119BX69	4.1250 % HCA 4 1/8 06/15/29	0	700	0	700 USD	94.00%	658'000.00	0.04	a)
US404119BY43	5.1250 % HCA 5 1/8 06/15/39	0	400	0	400 USD	93.00%	372'000.00	0.02	a)
US404119BZ18	5.2500 % HCA 5 1/4 06/15/49	0	700	0	700 USD	89.75%	628'250.00	0.04	a)
US404119CA57	3.5000 % HCA 3 1/2 09/01/30	0	850	0	850 USD	89.25%	758'625.00	0.05	a)
US404119CB31	3.5000 % HCA 3 1/2 07/15/51	0	500	0	500 USD	67.84%	339'201.50	0.02	a)
US404119CC14	2.3750 % HCA 2 3/8 07/15/31	0	350	0	350 USD	81.15%	284'018.35	0.02	a)
US404119CH01	3.1250 % HCA 3 1/8 03/15/27	0	400	0	400 USD	93.89%	375'563.60	0.02	a)
US404119CJ66	3.3750 % HCA 3 3/8 03/15/29	0	500	0	500 USD	91.15%	455'766.00	0.03	a)
US404119CK30	3.6250 % HCA 3 5/8 03/15/32	0	600	0	600 USD	87.84%	527'037.00	0.03	a)
US404119CL13	4.6250 % HCA 4 5/8 03/15/52	0	750	0	750 USD	82.06%	615'462.00	0.04	a)
US404119CP27	5.2000 % HCA 5.2 06/01/28	0	500	0	500 USD	99.80%	498'999.50	0.03	a)
US404119CQ00	5.5000 % HCA 5 1/2 06/01/33	0	600	0	600 USD	99.18%	595'060.20	0.04	a)
US404119CR82	5.9000 % HCA 5.9 06/01/53	0	400	0	400 USD	97.60%	390'395.60	0.02	a)
US404121AH82	5.3750 % HCA 5 3/8 09/01/26	0	400	0	400 USD	99.50%	398'000.00	0.02	a)
US404121AJ49	5.6250 % HCA 5 5/8 09/01/28	0	550	0	550 USD	100.50%	552'750.00	0.03	a)
US40414LAR06	3.5000 % PEAK 3 1/2 07/15/29	1'000	0	0	1'000 USD	91.25%	912'464.00	0.06	a)
US404280AM17	6.1000 % HSBC 6.1 01/14/42	350	0	0	350 USD	109.37%	382'806.55	0.02	a)
US404280AP48	4.2500 % HSBC 4 1/4 03/14/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280AQ21	5.2500 % HSBC 5 1/4 03/14/44	500	0	0	500 USD	95.14%	475'675.50	0.03	a)
US404280AU33	4.2500 % HSBC 4 1/4 08/18/25	600	0	0	600 USD	98.01%	588'070.20	0.04	a)
US404280AW98	4.3000 % HSBC 4.3 03/08/26	800	0	0	800 USD	97.91%	783'248.80	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 USD	in % 7)	Kat.
US404280BB43	3.9000 % HSBC 3.9 05/25/26	1'200	0	0	1'200 USD	96.91%	1'162'975.20	0.07	a)
US404280BK42	4.0410 % HSBC 4.041 03/13/28	600	0	0	600 USD	95.91%	575'448.60	0.04	a)
US404280BT50	4.5830 % HSBC 4.583 06/19/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.33%	963'298.00	0.06	a)
US404280BX62	4.2920 % HSBC 4.292 09/12/26	800	0	0	800 USD	97.75%	781'988.00	0.05	a)
US404280BZ11	3.8030 % HSBC 3.803 03/11/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280CC17	3.9730 % HSBC 3.973 05/22/30	500	0	0	500 USD	92.73%	463'635.00	0.03	a)
US404280CE72	2.6330 % HSBC 2.633 11/07/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280CF48	4.9500 % HSBC 4.95 03/31/30	500	0	0	500 USD	97.95%	489'772.00	0.03	a)
US404280CH04	2.8480 % HSBC 2.848 06/04/31	1'500	0	0	1'500 USD	85.05%	1'275'823.50	0.08	a)
US404280CJ69	1.6450 % HSBC 1.645 04/18/26	1'000	500	0	1'500 USD	95.53%	1'432'947.00	0.09	a)
US404280CK33	2.3570 % HSBC 2.357 08/18/31	500	0	0	500 USD	82.11%	410'540.00	0.03	a)
US404280CL16	2.0130 % HSBC 2.013 09/22/28	0	585	0	585 USD	88.21%	516'048.39	0.03	a)
US404280CM98	1.5890 % HSBC 1.589 05/24/27	1'000	0	0	1'000 USD	91.69%	916'915.00	0.06	a)
US404280CS68	0.9760 % HSBC 0.976 05/24/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280CT42	2.8040 % HSBC 2.804 05/24/32	500	0	0	500 USD	82.46%	412'312.50	0.03	a)
US404280CV97	2.2060 % HSBC 2.206 08/17/29	1'000	0	0	1'000 USD	86.64%	866'432.00	0.05	a)
US404280CX53	2.2510 % HSBC 2.251 11/22/27	500	0	0	500 USD	91.87%	459'359.00	0.03	a)
US404280CY37	2.8710 % HSBC 2.871 11/22/32	400	0	0	400 USD	82.30%	329'195.60	0.02	a)
US404280DC08	4.7620 % HSBC 4.762 03/29/33	500	0	0	500 USD	91.52%	457'608.50	0.03	a)
US404280DE63	4.1800 % HSBC 4.18 12/09/25	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US404280DF39	4.7550 % HSBC 4.755 06/09/28	300	0	0	300 USD	97.71%	293'116.20	0.02	a)
US404280DG12	5.2100 % HSBC 5.21 08/11/28	600	0	0	600 USD	99.03%	594'159.00	0.04	a)
US404280DH94	5.4020 % HSBC 5.402 08/11/33	0	400	0	400 USD	98.18%	392'708.80	0.02	a)
US404280DL07	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/02/36	520	0	0	520 USD	101.41%	527'338.76	0.03	a)
US404280DM89	6.5000 % HSBC 6 1/2 09/15/37	1'190	0	0	1'190 USD	102.76%	1'222'833.29	0.08	a)
US404280DN62	6.8000 % HSBC 6.8 06/01/38	550	0	0	550 USD	105.18%	578'516.40	0.04	a)
US404280DQ93	7.3360 % HSBC 7.336 11/03/26	0	500	0	500 USD	102.91%	514'553.50	0.03	a)
US404280DR76	7.3900 % HSBC 7.39 11/03/28	0	600	0	600 USD	105.97%	635'811.60	0.04	a)
US404280DS59	8.1130 % HSBC 8.113 11/03/33	600	0	0	600 USD	111.90%	671'427.60	0.04	a)
US404280DU06	6.1610 % HSBC 6.161 03/09/29	0	650	0	650 USD	101.59%	660'314.85	0.04	a)
US404280DV88	6.2540 % HSBC 6.254 03/09/34	0	800	0	800 USD	103.84%	830'717.60	0.05	a)
US404280DW61	6.3320 % HSBC 6.332 03/09/44	0	450	0	450 USD	105.34%	474'012.45	0.03	a)
US404280DX45	6.5470 % HSBC 6.547 06/20/34	0	500	0	500 USD	101.80%	508'976.00	0.03	a)
US404280DZ92	5.8870 % HSBC 5.887 08/14/27	0	750	0	750 USD	100.55%	754'113.00	0.05	a)
US404280EC98	7.3990 % HSBC 7.399 11/13/34	0	750	0	750 USD	107.25%	804'339.00	0.05	a)
US40428HTA04	3.7500 % HSBC 3 3/4 05/24/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4042Q1AD94	7.0000 % HSBC 7 01/15/39 BKNT	500	0	0	500 USD	114.21%	571'052.50	0.04	a)
US40434CAD74	3.5000 % HSBC 3 1/2 06/23/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAA35	2.2000 % HPQ 2.2 06/17/25	500	0	0	500 USD	96.01%	480'031.00	0.03	a)
US40434LAB18	3.0000 % HPQ 3 06/17/27	0	300	0	300 USD	93.45%	280'355.40	0.02	a)
US40434LAC90	3.4000 % HPQ 3.4 06/17/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US40434LAF22	1.4500 % HPQ 1.45 06/17/26	300	0	0	300 USD	91.74%	275'221.80	0.02	a)
US40434LAK17	4.0000 % HPQ 4 04/15/29	250	0	0	250 USD	95.01%	237'521.75	0.01	a)
US40434LAL99	4.2000 % HPQ 4.2 04/15/32	500	0	0	500 USD	92.26%	461'309.00	0.03	a)
US40434LAM72	4.7500 % HPQ 4 3/4 01/15/28	500	0	0	500 USD	98.99%	494'962.00	0.03	a)
US40434LAN55	5.5000 % HPQ 5 1/2 01/15/33	300	0	0	300 USD	99.83%	299'498.10	0.02	a)
US406216AW19	6.7000 % HAL 6.7 09/15/38	500	0	0	500 USD	112.21%	561'034.50	0.04	a)
US406216AY74	7.4500 % HAL 7.45 09/15/39	100	0	0	100 USD	119.99%	119'991.30	0.01	a)
US406216BA89	4.5000 % HAL 4 1/2 11/15/41	200	0	0	200 USD	87.61%	175'216.40	0.01	a)
US406216BE02	4.7500 % HAL 4 3/4 08/01/43	750	0	0	750 USD	90.72%	680'388.00	0.04	a)
US406216BJ98	4.8500 % HAL 4.85 11/15/35	250	0	0	250 USD	96.46%	241'138.75	0.02	a)
US406216BK61	5.0000 % HAL 5 11/15/45	250	0	0	250 USD	92.56%	231'401.25	0.01	a)
US406216BL45	2.9200 % HAL 2.92 03/01/30	500	0	0	500 USD	88.74%	443'678.50	0.03	a)
US416515BE33	2.8000 % HIG 2.8 08/19/29	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US416515BF08	3.6000 % HIG 3.6 08/19/49	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US416518AD08	2.9000 % HIG 2.9 09/15/51	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US418056AS62	6.3500 % HAS 6.35 03/15/40	0	200	0	200 USD	101.21%	202'417.80	0.01	a)
US418056AV91	3.5000 % HAS 3 1/2 09/15/27	200	0	0	200 USD	93.96%	187'919.00	0.01	a)
US418056AX57	3.0000 % HAS 3 11/19/24	200	0	0	200 USD	98.17%	196'348.00	0.01	a)
US418056AY31	3.5500 % HAS 3.55 11/19/26	250	0	0	250 USD	94.97%	237'418.25	0.01	a)
US418056AZ06	3.9000 % HAS 3.9 11/19/29	400	0	0	400 USD	91.54%	366'143.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US42217KBF21	4.0000 % WELL 4 06/01/25	250	0	0	250 USD	98.16%	245'393.50	0.02	a)
US42225UAG94	3.1000 % HR 3.1 02/15/30	0	450	0	450 USD	86.00%	387'008.10	0.02	a)
US42225UAH77	2.0000 % HR 2 03/15/31	0	400	0	400 USD	78.42%	313'690.80	0.02	a)
US42250PAA12	3.0000 % PEAK 3 01/15/30	500	0	0	500 USD	87.47%	437'359.50	0.03	a)
US42250PAE34	5.2500 % PEAK 5 1/4 12/15/32	0	250	0	250 USD	97.56%	243'909.25	0.02	a)
US422806AA75	5.2500 % HEI 5 1/4 08/01/28	0	160	0	160 USD	100.51%	160'823.84	0.01	a)
US422806AB58	5.3500 % HEI 5.35 08/01/33	0	250	0	250 USD	99.13%	247'826.25	0.02	a)
US423452AG66	2.9000 % HP 2.9 09/29/31	0	100	0	100 USD	83.01%	83'011.10	0.01	a)
US42809HAC16	6.0000 % HES 6 01/15/40	500	0	0	500 USD	104.21%	521'055.00	0.03	a)
US42809HAD98	5.6000 % HES 5.6 02/15/41	500	0	0	500 USD	100.73%	503'644.50	0.03	a)
US42809HAG20	4.3000 % HES 4.3 04/01/27	500	0	0	500 USD	97.41%	487'059.50	0.03	a)
US42809HAH03	5.8000 % HES 5.8 04/01/47	250	0	0	250 USD	101.04%	252'610.25	0.02	a)
US428236BR31	6.0000 % HPQ 6 09/15/41	400	0	0	400 USD	102.57%	410'283.60	0.03	a)
US42824CAW91	4.9000 % HPE 4.9 10/15/25	750	0	0	750 USD	99.27%	744'561.00	0.05	a)
US42824CAX74	6.2000 % HPE 6.2 10/15/35	650	0	0	650 USD	104.14%	676'915.20	0.04	a)
US42824CAY57	6.3500 % HPE 6.35 10/15/45	500	0	0	500 USD	103.07%	515'355.50	0.03	a)
US42824CBK45	1.7500 % HPE 1 3/4 04/01/26	500	0	0	500 USD	92.92%	464'613.00	0.03	a)
US42824CBP32	5.2500 % HPE 5 1/4 07/01/28	0	150	0	150 USD	100.02%	150'026.25	0.01	a)
US437076AS19	5.8750 % HD 5 7/8 12/16/36	900	0	0	900 USD	106.63%	959'652.90	0.06	a)
US437076AU64	5.4000 % HD 5.4 09/15/40	400	0	0	400 USD	100.41%	401'630.00	0.03	a)
US437076AV48	5.9500 % HD 5.95 04/01/41	100	0	0	100 USD	106.59%	106'586.50	0.01	a)
US437076AZ51	2.7000 % HD 2.7 04/01/23	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076BA91	4.2000 % HD 4.2 04/01/43	100	0	0	100 USD	86.17%	86'167.80	0.01	a)
US437076BC57	3.7500 % HD 3 3/4 02/15/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US437076BD31	4.8750 % HD 4 7/8 02/15/44	600	0	0	600 USD	93.87%	563'224.80	0.04	a)
US437076BF88	4.4000 % HD 4.4 03/15/45	600	0	0	600 USD	87.58%	525'453.60	0.03	a)
US437076BH45	4.2500 % HD 4 1/4 04/01/46	300	0	0	300 USD	85.49%	256'482.00	0.02	a)
US437076BK73	3.3500 % HD 3.35 09/15/25	500	0	0	500 USD	97.51%	487'533.00	0.03	a)
US437076BM30	3.0000 % HD 3 04/01/26	500	0	0	500 USD	96.35%	481'750.00	0.03	a)
US437076BN13	2.1250 % HD 2 1/8 09/15/26	250	0	0	250 USD	93.40%	233'492.00	0.01	a)
US437076BP60	3.5000 % HD 3 1/2 09/15/56	1'200	0	0	1'200 USD	73.58%	882'916.80	0.06	a)
US437076BS00	3.9000 % HD 3.9 06/15/47	400	0	0	400 USD	80.77%	323'067.20	0.02	a)
US437076BT82	2.8000 % HD 2.8 09/14/27	750	0	0	750 USD	93.63%	702'259.50	0.04	a)
US437076BW12	3.9000 % HD 3.9 12/06/28	500	0	0	500 USD	96.63%	483'161.00	0.03	a)
US437076BX94	4.5000 % HD 4 1/2 12/06/48	1'000	0	0	1'000 USD	88.24%	882'403.00	0.06	a)
US437076BZ43	3.1250 % HD 3 1/8 12/15/49	500	0	0	500 USD	69.84%	349'207.50	0.02	a)
US437076CA82	2.5000 % HD 2 1/2 04/15/27	0	260	0	260 USD	93.12%	242'121.10	0.02	a)
US437076CB65	2.7000 % HD 2.7 04/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	88.52%	885'161.00	0.06	a)
US437076CF79	1.3750 % HD 1 3/8 03/15/31	500	0	0	500 USD	79.15%	395'772.50	0.02	a)
US437076CG52	2.3750 % HD 2 3/8 03/15/51	500	0	0	500 USD	58.72%	293'575.50	0.02	a)
US437076CH36	1.5000 % HD 1 1/2 09/15/28	0	300	0	300 USD	87.05%	261'160.20	0.02	a)
US437076CJ91	1.8750 % HD 1 7/8 09/15/31	0	300	0	300 USD	80.95%	242'857.20	0.02	a)
US437076CP51	3.2500 % HD 3 1/4 04/15/32	0	400	0	400 USD	88.69%	354'769.60	0.02	a)
US437076CQ35	3.6250 % HD 3 5/8 04/15/52	0	300	0	300 USD	75.58%	226'730.40	0.01	a)
US437076CS90	4.5000 % HD 4 1/2 09/15/32	0	400	0	400 USD	97.58%	390'312.80	0.02	a)
US438127AA08	2.2710 % HNDA 2.271 03/10/25	250	0	0	250 USD	97.12%	242'789.25	0.02	a)
US438127AB80	2.5340 % HNDA 2.534 03/10/27	250	0	0	250 USD	93.26%	233'155.00	0.01	a)
US438127AC63	2.9670 % HNDA 2.967 03/10/32	250	0	0	250 USD	87.89%	219'735.25	0.01	a)
US440452AF79	1.8000 % HRL 1.8 06/11/30	500	0	0	500 USD	82.96%	414'795.50	0.03	a)
US440452AH36	1.7000 % HRL 1.7 06/03/28	500	0	0	300 USD	88.28%	264'852.00	0.02	a)
US44107TAZ93	3.5000 % HST 3 1/2 09/15/30 I	500	0	0	500 USD	88.24%	441'202.50	0.03	a)
US444859BD30	3.8500 % HUM 3.85 10/01/24	250	0	0	250 USD	98.93%	247'327.50	0.02	a)
US444859BE13	4.9500 % HUM 4.95 10/01/44	750	0	0	750 USD	90.51%	678'856.50	0.04	a)
US444859BF87	3.9500 % HUM 3.95 03/15/27	400	0	0	400 USD	96.60%	386'418.00	0.02	a)
US444859BK72	3.1250 % HUM 3 1/8 08/15/29	400	0	0	400 USD	90.52%	362'094.40	0.02	a)
US444859BU54	5.7500 % HUM 5 3/4 03/01/28	200	0	0	200 USD	101.74%	203'487.00	0.01	a)
US444859BV38	5.8750 % HUM 5 7/8 03/01/33	400	0	0	400 USD	103.00%	412'001.60	0.03	a)
US444859BW11	5.7000 % HUM 5.7 03/13/26	0	150	0	150 USD	99.85%	149'769.90	0.01	a)
US444859BX93	5.5000 % HUM 5 1/2 03/15/53	0	300	0	300 USD	97.40%	292'205.10	0.02	a)
US444859BY76	5.9500 % HUM 5.95 03/15/34	0	250	0	250 USD	103.32%	258'305.25	0.02	a)
US444859BZ42	5.7500 % HUM 5 3/4 12/01/28	0	200	0	200 USD	102.16%	204'320.40	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US446150AQ78	2.6250 % HBAN 2 5/8 08/06/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US446150AS35	2.5500 % HBAN 2.55 02/04/30	0	560	0	560 USD	83.98%	470'263.92	0.03 a)	
US446150BB90	4.4430 % HBAN 4.443 08/04/28	500	0	0	500 USD	95.82%	479'093.00	0.03 a)	
US44644MAF86	4.5520 % HBAN 4.552 05/17/28	500	0	0	500 USD	96.00%	480'008.00	0.03 a)	
US44701QBE17	4.5000 % HUN 4 1/2 05/01/29	400	0	0	400 USD	94.70%	378'809.60	0.02 a)	
US45167RAG92	3.0000 % IEX 3 05/01/30	0	150	0	150 USD	87.28%	130'919.70	0.01 a)	
US45167RAH75	2.6250 % IEX 2 5/8 06/15/31	0	150	0	150 USD	84.27%	126'406.50	0.01 a)	
US452308AR01	3.9000 % ITW 3.9 09/01/42	701	0	0	701 USD	84.86%	594'882.62	0.04 a)	
US452308AT66	3.5000 % ITW 3 1/2 03/01/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US452308AX78	2.6500 % ITW 2.65 11/15/26	500	0	0	500 USD	94.87%	474'344.50	0.03 a)	
US452327AP42	5.7500 % ILMN 5 3/4 12/13/27	500	0	0	500 USD	100.36%	501'782.50	0.03 a)	
US454889AV81	5.6250 % AEP 5 5/8 04/01/53	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837AH61	3.9500 % INTNED 3.95 03/29/27	500	0	0	500 USD	96.30%	481'487.50	0.03 a)	
US456837AM56	4.5500 % INTNED 4.55 10/02/28	1'000	0	0	1'000 USD	97.13%	971'316.00	0.06 a)	
US456837AP87	3.5500 % INTNED 3.55 04/09/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US456837AQ60	4.0500 % INTNED 4.05 04/09/29	500	0	0	500 USD	94.50%	472'517.00	0.03 a)	
US456837BA00	3.8690 % INTNED 3.869 03/28/26	0	200	0	200 USD	98.29%	196'589.80	0.01 a)	
US456837BC65	4.2520 % INTNED 4.252 03/28/33	0	400	0	400 USD	91.94%	367'752.80	0.02 a)	
US456837BF96	6.0830 % INTNED 6.083 09/11/27	0	350	0	350 USD	101.26%	354'426.45	0.02 a)	
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	0	350	0	350 USD	103.30%	361'551.75	0.02 a)	
US456873AD03	3.8000 % TT 3.8 03/21/29	0	200	0	200 USD	94.55%	189'090.00	0.01 a)	
US45687AAG76	5.7500 % TT 5 3/4 06/15/43	0	140	0	140 USD	102.93%	144'107.04	0.01 a)	
US45687AAP75	3.7500 % TT 3 3/4 08/21/28	200	0	0	200 USD	95.67%	191'346.20	0.01 a)	
US45687VAA44	5.4000 % IR 5.4 08/14/28	0	200	0	200 USD	100.77%	201'549.00	0.01 a)	
US45687VAB27	5.7000 % IR 5.7 08/14/33	0	350	0	350 USD	101.45%	355'079.55	0.02 a)	
US457187AB87	3.2000 % INGR 3.2 10/01/26	0	300	0	300 USD	95.14%	285'408.00	0.02 a)	
US458140AN04	4.0000 % INTC 4 12/15/32	1'030	0	0	1'030 USD	92.19%	949'593.05	0.06 a)	
US458140AS90	3.7000 % INTC 3.7 07/29/25	500	0	0	500 USD	97.95%	489'750.50	0.03 a)	
US458140AT73	4.9000 % INTC 4.9 07/29/45	500	0	0	500 USD	94.55%	472'738.00	0.03 a)	
US458140AU47	2.6000 % INTC 2.6 05/19/26	1'250	0	0	1'250 USD	95.05%	1'188'181.25	0.07 a)	
US458140AX85	3.1500 % INTC 3.15 05/11/27	500	0	0	500 USD	94.79%	473'971.50	0.03 a)	
US458140AY68	4.1000 % INTC 4.1 05/11/47	500	500	0	1'000 USD	82.29%	822'866.00	0.05 a)	
US458140BD13	2.8750 % INTC 2 7/8 05/11/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140BG44	3.7340 % INTC 3.734 12/08/47	902	0	0	902 USD	76.43%	689'440.09	0.04 a)	
US458140BH27	2.4500 % INTC 2.45 11/15/29	500	0	0	500 USD	87.65%	438'239.00	0.03 a)	
US458140BJ82	3.2500 % INTC 3 1/4 11/15/49	500	200	0	700 USD	69.02%	483'133.00	0.03 a)	
US458140BK55	3.1000 % INTC 3.1 02/15/60	1'000	0	0	1'000 USD	63.28%	632'781.00	0.04 a)	
US458140BM12	4.7500 % INTC 4 3/4 03/25/50	500	200	0	700 USD	89.14%	624'006.60	0.04 a)	
US458140BN94	4.9500 % INTC 4.95 03/25/60	500	0	0	500 USD	91.01%	455'040.50	0.03 a)	
US458140BP43	3.4000 % INTC 3.4 03/25/25	500	0	0	500 USD	98.08%	490'377.50	0.03 a)	
US458140BR09	3.9000 % INTC 3.9 03/25/30	1'000	0	0	1'000 USD	94.07%	940'691.00	0.06 a)	
US458140BT64	1.6000 % INTC 1.6 08/12/28	0	300	0	300 USD	87.11%	261'337.50	0.02 a)	
US458140CB48	4.9000 % INTC 4.9 08/05/52	0	650	0	650 USD	91.74%	596'306.75	0.04 a)	
US458140CE86	4.8750 % INTC 4 7/8 02/10/28	0	500	0	500 USD	99.95%	499'747.00	0.03 a)	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	0	600	0	600 USD	99.84%	599'062.80	0.04 a)	
US458140CH18	5.6250 % INTC 5 5/8 02/10/43	0	300	0	300 USD	101.65%	304'945.50	0.02 a)	
US458140CJ73	5.7000 % INTC 5.7 02/10/53	0	650	0	650 USD	101.55%	660'065.90	0.04 a)	
US458140CK47	5.9000 % INTC 5.9 02/10/63	0	600	0	600 USD	103.50%	620'996.40	0.04 a)	
US45866FAD69	3.7500 % ICE 3 3/4 12/01/25	0	500	0	500 USD	97.38%	486'887.00	0.03 a)	
US45866FAH73	4.2500 % ICE 4 1/4 09/21/48	0	60	0	60 USD	84.99%	50'993.40	0.00 a)	
US45866FAK03	2.1000 % ICE 2.1 06/15/30	0	450	0	450 USD	83.85%	377'333.10	0.02 a)	
US45866FAP99	2.6500 % ICE 2.65 09/15/40	0	600	0	600 USD	70.77%	424'633.20	0.03 a)	
US45866FAQ72	3.0000 % ICE 3 09/15/60	0	500	0	500 USD	62.45%	312'246.50	0.02 a)	
US45866FAU84	4.0000 % ICE 4 09/15/27	0	500	0	500 USD	96.66%	483'322.00	0.03 a)	
US45866FAV67	4.3500 % ICE 4.35 06/15/29	0	500	0	500 USD	96.98%	484'898.50	0.03 a)	
US45866FAW41	4.6000 % ICE 4.6 03/15/33	0	750	0	750 USD	95.50%	716'229.00	0.04 a)	
US45866FAX24	4.9500 % ICE 4.95 06/15/52	0	750	0	750 USD	93.72%	702'930.75	0.04 a)	
US45866FAY07	5.2000 % ICE 5.2 06/15/62	0	300	0	300 USD	95.87%	287'610.30	0.02 a)	
US459200BB69	5.8750 % IBM 5 7/8 11/29/32	300	0	0	300 USD	105.37%	316'108.80	0.02 a)	
US459200GS40	5.6000 % IBM 5.6 11/30/39	200	0	0	200 USD	103.32%	206'636.60	0.01 a)	
US459200HF10	4.0000 % IBM 4 06/20/42	320	0	0	320 USD	83.16%	266'113.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US459200HU86	3.6250 % IBM 3 5/8 02/12/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200JG74	3.4500 % IBM 3.45 02/19/26	650	0	0	650 USD	97.00%	630'478.55	0.04	a)
US459200JR30	3.3000 % IBM 3.3 01/27/27	250	0	0	250 USD	95.58%	238'951.25	0.01	a)
US459200JY80	3.0000 % IBM 3 05/15/24	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200JZ55	3.3000 % IBM 3.3 05/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	96.33%	963'252.00	0.06	a)
US459200KA85	3.5000 % IBM 3 1/2 05/15/29	750	0	0	750 USD	93.58%	701'882.25	0.04	a)
US459200KB68	4.1500 % IBM 4.15 05/15/39	500	0	0	500 USD	87.20%	436'000.50	0.03	a)
US459200KC42	4.2500 % IBM 4 1/4 05/15/49	900	500	0	1'400 USD	83.76%	1'172'693.20	0.07	a)
US459200KH39	1.7000 % IBM 1.7 05/15/27	0	360	0	360 USD	90.25%	324'893.52	0.02	a)
US459200KJ94	1.9500 % IBM 1.95 05/15/30	800	0	0	800 USD	83.63%	669'047.20	0.04	a)
US459200KL41	2.9500 % IBM 2.95 05/15/50	500	0	0	500 USD	65.94%	329'711.00	0.02	a)
US459200KP54	3.4300 % IBM 3.43 02/09/52	0	100	0	100 USD	71.51%	71'514.20	0.00	a)
US459200KT76	4.1500 % IBM 4.15 07/27/27	500	0	0	500 USD	97.27%	486'347.00	0.03	a)
US459200KV23	4.9000 % IBM 4.9 07/27/52	500	0	0	500 USD	92.35%	461'730.50	0.03	a)
US459200KX88	4.5000 % IBM 4 1/2 02/06/28	0	300	0	300 USD	98.60%	295'795.50	0.02	a)
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	0	200	0	200 USD	95.39%	190'775.20	0.01	a)
US459506AE19	4.3750 % IFF 4 3/8 06/01/47	0	200	0	200 USD	74.69%	149'379.80	0.01	a)
US459506AL51	5.0000 % IFF 5 09/26/48	0	200	0	200 USD	83.96%	167'917.60	0.01	a)
US460146CK70	4.8000 % IP 4.8 06/15/44	297	0	0	297 USD	88.83%	263'824.80	0.02	a)
US460146CQ41	4.4000 % IP 4.4 08/15/47	785	0	0	785 USD	82.72%	649'334.73	0.04	a)
US460146CS07	4.3500 % IP 4.35 08/15/48	300	0	0	300 USD	84.88%	254'649.90	0.02	a)
US460690BQ26	5.4000 % IPG 5.4 10/01/48	0	200	0	200 USD	92.27%	184'531.00	0.01	a)
US460690BR09	4.7500 % IPG 4 3/4 03/30/30	1'000	0	0	1'000 USD	96.93%	969'291.00	0.06	a)
US46124HAC07	1.3500 % INTU 1.35 07/15/27	500	0	0	500 USD	89.25%	446'229.50	0.03	a)
US46124HAE62	5.2500 % INTU 5 1/4 09/15/26	0	200	0	200 USD	100.82%	201'632.60	0.01	a)
US46124HAF38	5.1250 % INTU 5 1/8 09/15/28	0	250	0	250 USD	101.20%	253'001.75	0.02	a)
US46124HAG11	5.2000 % INTU 5.2 09/15/33	0	300	0	300 USD	101.21%	303'643.20	0.02	a)
US46124HAH93	5.5000 % INTU 5 1/2 09/15/53	0	515	0	515 USD	102.86%	529'748.57	0.03	a)
US46132FAD24	3.7500 % IVZ 3 3/4 01/15/26	250	0	0	250 USD	97.12%	242'807.00	0.02	a)
US46266TAB44	5.7000 % IQV 5.7 05/15/28 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46266TAC27	5.7000 % IQV 5.7 05/15/28	0	200	0	200 USD	100.78%	201'553.08	0.01	a)
US46266TAE82	6.2500 % IQV 6 1/4 02/01/29 144A	0	400	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46266TAF57	6.2500 % IQV 6 1/4 02/01/29	0	400	0	400 USD	102.88%	411'535.80	0.03	a)
US46590XAT37	3.6250 % JBSSBZ 3 5/8 01/15/32 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HHF01	6.4000 % JPM 6.4 05/15/38	745	0	0	745 USD	111.80%	832'887.65	0.05	a)
US46625HHV50	5.5000 % JPM 5 1/2 10/15/40	330	200	0	530 USD	102.25%	541'914.40	0.03	a)
US46625HJB78	5.6000 % JPM 5.6 07/15/41	530	0	0	530 USD	103.10%	546'435.30	0.03	a)
US46625HJM34	5.6250 % JPM 5 5/8 08/16/43	600	0	0	600 USD	102.00%	611'979.60	0.04	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJX98	3.6250 % JPM 3 5/8 05/13/24	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJZ47	4.1250 % JPM 4 1/8 12/15/26	500	0	0	500 USD	97.62%	488'122.50	0.03	a)
US46625HKC33	3.1250 % JPM 3 1/8 01/23/25	1'550	0	0	1'550 USD	98.09%	1'520'395.00	0.09	a)
US46625HMN79	3.9000 % JPM 3.9 07/15/25	1'100	0	0	1'100 USD	98.26%	1'080'847.90	0.07	a)
US46625HNJ58	4.2500 % JPM 4 1/4 10/01/27	700	0	0	700 USD	98.11%	686'793.10	0.04	a)
US46625HQW33	3.3000 % JPM 3.3 04/01/26	1'500	0	0	1'500 USD	96.44%	1'446'588.00	0.09	a)
US46625HRS12	3.2000 % JPM 3.2 06/15/26	750	0	0	750 USD	96.17%	721'272.00	0.05	a)
US46625HRV41	2.9500 % JPM 2.95 10/01/26	800	0	0	800 USD	94.91%	759'280.80	0.05	a)
US46625HRX07	3.6250 % JPM 3 5/8 12/01/27	250	0	0	250 USD	95.09%	237'717.50	0.01	a)
US46625HRY89	3.7820 % JPM 3.782 02/01/28	400	350	0	750 USD	96.17%	721'287.00	0.05	a)
US466313AH63	3.9500 % JBL 3.95 01/12/28	750	0	0	750 USD	94.16%	706'235.25	0.04	a)
US466313AL75	1.7000 % JBL 1.7 04/15/26	400	0	0	400 USD	92.36%	369'435.60	0.02	a)
US46647PAA49	4.2600 % JPM 4.26 02/22/48	500	200	0	700 USD	84.66%	592'636.10	0.04	a)
US46647PAF36	3.5400 % JPM 3.54 05/01/28	1'000	0	0	1'000 USD	95.04%	950'419.00	0.06	a)
US46647PAH91	3.2200 % JPM 3.22 03/01/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PAJ57	3.8820 % JPM 3.882 07/24/38	500	200	0	700 USD	84.98%	594'886.60	0.04	a)
US46647PAK21	4.0320 % JPM 4.032 07/24/48	0	350	0	350 USD	81.48%	285'188.05	0.02	a)
US46647PAL04	3.9640 % JPM 3.964 11/15/48	1'000	0	0	1'000 USD	80.46%	804'593.00	0.05	a)
US46647PAM86	3.5090 % JPM 3.509 01/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	94.31%	943'050.00	0.06	a)
US46647PAN69	3.8970 % JPM 3.897 01/23/49	1'000	0	0	1'000 USD	80.22%	802'173.00	0.05	a)
US46647PAR73	4.0050 % JPM 4.005 04/23/29	500	0	0	500 USD	95.25%	476'233.00	0.03	a)
US46647PAV85	4.2030 % JPM 4.203 07/23/29	500	0	0	500 USD	96.00%	479'998.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US46647PAX42	4.4520 % JPM 4.452 12/05/29	500	0	0	500 USD	96.30%	481'492.00	0.03	a)
US46647PBA30	3.9600 % JPM 3.96 01/29/27	1'000	0	0	1'000 USD	97.39%	973'928.00	0.06	a)
US46647PBD78	3.7020 % JPM 3.702 05/06/30	600	0	0	600 USD	93.19%	559'161.60	0.03	a)
US46647PBE51	2.7390 % JPM 2.739 10/15/30	1'000	400	0	1'400 USD	87.73%	1'228'252.20	0.08	a)
US46647PBF27	2.3010 % JPM 2.301 10/15/25	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PBJ49	4.4930 % JPM 4.493 03/24/31	700	0	0	700 USD	95.60%	669'227.30	0.04	a)
US46647PBK12	2.0830 % JPM 2.083 04/22/26	800	0	0	800 USD	95.99%	767'892.00	0.05	a)
US46647PBL94	2.5220 % JPM 2.522 04/22/31	1'000	0	0	1'000 USD	84.98%	849'803.00	0.05	a)
US46647PBM77	3.1090 % JPM 3.109 04/22/41	300	0	0	300 USD	75.56%	226'690.80	0.01	a)
US46647PBN50	3.1090 % JPM 3.109 04/22/51	700	0	0	700 USD	68.70%	480'923.80	0.03	a)
US46647PBP09	2.9560 % JPM 2.956 05/13/31	1'000	0	0	1'000 USD	86.86%	868'644.00	0.05	a)
US46647PBT21	1.0450 % JPM 1.045 11/19/26	500	0	0	500 USD	92.93%	464'633.50	0.03	a)
US46647PBU93	1.7640 % JPM 1.764 11/19/31	900	0	0	900 USD	80.14%	721'241.10	0.05	a)
US46647PBW59	1.0400 % JPM 1.04 02/04/27	250	0	0	250 USD	92.19%	230'468.50	0.01	a)
US46647PBX33	1.9530 % JPM 1.953 02/04/32	750	0	0	750 USD	80.61%	604'554.00	0.04	a)
US46647PCB04	1.5780 % JPM 1.578 04/22/27	1'000	0	0	1'000 USD	92.56%	925'638.00	0.06	a)
US46647PCC86	2.5800 % JPM 2.58 04/22/32	0	500	0	500 USD	83.76%	418'795.00	0.03	a)
US46647PCD69	3.1570 % JPM 3.157 04/22/42	500	0	0	500 USD	75.01%	375'025.50	0.02	a)
US46647PCE43	3.3280 % JPM 3.328 04/22/52	1'000	200	0	1'200 USD	70.95%	851'354.40	0.05	a)
US46647PCJ30	2.0690 % JPM 2.069 06/01/29	250	300	0	550 USD	88.28%	485'548.80	0.03	a)
US46647PCK03	0.9690 % JPM 0.969 06/23/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCP99	1.4700 % JPM 1.47 09/22/27	500	150	0	650 USD	90.42%	587'728.70	0.04	a)
US46647PCR55	2.5450 % JPM 2.545 11/08/32	1'500	0	0	1'500 USD	82.32%	1'234'759.50	0.08	a)
US46647PCT12	1.5610 % JPM 1.561 12/10/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	800	224	0	1'024 USD	84.61%	866'399.23	0.05	a)
US46647PCV67	2.5950 % JPM 2.595 02/24/26	0	400	0	400 USD	97.28%	389'120.40	0.02	a)
US46647PCW41	2.9470 % JPM 2.947 02/24/28	600	0	0	600 USD	93.70%	562'218.60	0.04	a)
US46647PCZ71	4.0800 % JPM 4.08 04/26/26	300	500	0	800 USD	98.40%	787'209.60	0.05	a)
US46647PDA12	4.3230 % JPM 4.323 04/26/28	700	150	0	850 USD	97.57%	829'334.80	0.05	a)
US46647PDC77	4.5860 % JPM 4.586 04/26/33	500	200	0	700 USD	94.74%	663'146.40	0.04	a)
US46647PDE34	3.8450 % JPM 3.845 06/14/25	970	0	970	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDF09	4.5650 % JPM 4.565 06/14/30	500	1'000	0	1'500 USD	96.86%	1'452'973.50	0.09	a)
US46647PDG81	4.8510 % JPM 4.851 07/25/28	1'000	250	0	1'250 USD	99.07%	1'238'386.25	0.08	a)
US46647PDH64	4.9120 % JPM 4.912 07/25/33	1'000	250	0	1'250 USD	97.35%	1'216'828.75	0.08	a)
US46647PDK93	5.7170 % JPM 5.717 09/14/33	800	500	0	1'300 USD	101.09%	1'314'202.50	0.08	a)
US46647PDM59	5.5460 % JPM 5.546 12/15/25	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PDR47	5.3500 % JPM 5.35 06/01/34	0	1'400	0	1'400 USD	99.35%	1'390'911.20	0.09	a)
US46647PDU75	5.2990 % JPM 5.299 07/24/29	0	800	0	800 USD	100.44%	803'492.80	0.05	a)
US46647PDW32	6.0700 % JPM 6.07 10/22/27	0	800	0	800 USD	101.92%	815'365.60	0.05	a)
US46647PDX15	6.0870 % JPM 6.087 10/23/29	0	660	0	660 USD	103.46%	682'856.46	0.04	a)
US46647PDY97	6.2540 % JPM 6.254 10/23/34	0	1'070	0	1'070 USD	106.26%	1'136'992.70	0.07	a)
US46647PEA03	5.0400 % JPM 5.04 01/23/28	0	780	0	780 USD	99.70%	777'695.10	0.05	a)
US46647PEB85	5.0120 % JPM 5.012 01/23/30	0	800	0	800 USD	98.71%	789'648.80	0.05	a)
US46647PEC68	5.3360 % JPM 5.336 01/23/35	0	950	0	950 USD	99.52%	945'446.65	0.06	a)
US469814AA50	5.9000 % J 5.9 03/01/33	0	150	0	150 USD	100.04%	150'060.15	0.01	a)
US469814AB34	6.3500 % J 6.35 08/18/28	0	170	0	170 USD	103.34%	175'685.14	0.01	a)
US47215PAC05	3.8750 % JD 3 7/8 04/29/26	0	500	0	500 USD	96.90%	484'483.50	0.03	a)
US47215PAE60	3.3750 % JD 3 3/8 01/14/30	0	800	0	800 USD	90.42%	723'396.00	0.05	a)
US477164AA59	4.0000 % JBLU 4 11/15/32 1A	0	150	0	150 USD	91.19%	136'777.65	0.01	a)
US478160AL82	4.9500 % JNJ 4.95 05/15/33	300	0	0	300 USD	102.36%	307'094.70	0.02	a)
US478160AN49	5.9500 % JNJ 5.95 08/15/37	400	0	0	400 USD	108.46%	433'858.80	0.03	a)
US478160AV64	4.5000 % JNJ 4 1/2 09/01/40	100	0	0	100 USD	94.52%	94'520.70	0.01	a)
US478160BJ28	4.3750 % JNJ 4 3/8 12/05/33	300	0	0	300 USD	97.97%	293'895.00	0.02	a)
US478160BK90	4.5000 % JNJ 4 1/2 12/05/43	250	0	0	250 USD	94.19%	235'466.00	0.01	a)
US478160BU72	3.5500 % JNJ 3.55 03/01/36	450	0	0	450 USD	87.81%	395'161.65	0.02	a)
US478160BV55	3.7000 % JNJ 3.7 03/01/46	750	0	0	750 USD	82.29%	617'184.00	0.04	a)
US478160BY94	2.4500 % JNJ 2.45 03/01/26	500	0	0	500 USD	95.68%	478'406.00	0.03	a)
US478160CE22	2.9500 % JNJ 2.95 03/03/27	200	0	0	200 USD	95.46%	190'926.60	0.01	a)
US478160CF96	3.6250 % JNJ 3 5/8 03/03/37	1'000	0	0	1'000 USD	87.31%	873'057.00	0.05	a)
US478160CG79	3.7500 % JNJ 3 3/4 03/03/47	250	0	0	250 USD	82.46%	206'154.75	0.01	a)
US478160CK81	2.9000 % JNJ 2.9 01/15/28	500	0	0	500 USD	94.51%	472'535.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US478160CL64	3.4000 % JNJ 3.4 01/15/38	500	0	0	500 USD	84.10%	420'479.50	0.03	a)
US478160CM48	3.5000 % JNJ 3 1/2 01/15/48	650	0	0	650 USD	79.28%	515'320.65	0.03	a)
US478160CN21	0.5500 % JNJ 0.55 09/01/25	500	0	0	500 USD	93.78%	468'898.00	0.03	a)
US478160CQ51	1.3000 % JNJ 1.3 09/01/30	500	0	0	500 USD	81.82%	409'076.00	0.03	a)
US478375AU25	4.5000 % JCI 4 1/2 02/15/47	0	250	0	250 USD	85.33%	213'324.00	0.01	a)
US47837RAA86	1.7500 % JCI 1 3/4 09/15/30	250	0	0	250 USD	81.77%	204'424.50	0.01	a)
US47837RAD26	2.0000 % JCI 2 09/16/31	0	100	0	100 USD	80.40%	80'402.50	0.01	a)
US48125LRU88	5.1100 % JPM 5.11 12/08/26	0	700	0	700 USD	99.93%	699'531.70	0.04	a)
US48126BAA17	5.4000 % JPM 5.4 01/06/42	700	0	0	700 USD	100.65%	704'529.00	0.04	a)
US482480AE03	4.6500 % KLAC 4.65 11/01/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US482480AJ99	3.3000 % KLAC 3.3 03/01/50	0	200	0	200 USD	71.91%	143'816.40	0.01	a)
US482480AL46	4.6500 % KLAC 4.65 07/15/32	500	0	0	500 USD	97.51%	487'556.00	0.03	a)
US482480AM29	4.9500 % KLAC 4.95 07/15/52	400	0	0	400 USD	94.47%	377'871.20	0.02	a)
US482480AN02	5.2500 % KLAC 5 1/4 07/15/62	0	250	0	250 USD	96.37%	240'934.75	0.02	a)
US48305QAB95	4.8750 % KPERM 4 7/8 04/01/42	250	0	0	250 USD	94.96%	237'405.75	0.01	a)
US48305QAC78	3.1500 % KPERM 3.15 05/01/27	250	0	0	250 USD	94.84%	237'099.00	0.01	a)
US48305QAF00	2.8100 % KPERM 2.81 06/01/41 2021	500	0	0	500 USD	72.72%	363'590.50	0.02	a)
US48305QAG82	3.0020 % KPERM 3.002 06/01/51 2021	750	0	0	750 USD	68.52%	513'871.50	0.03	a)
US487836BP25	3.2500 % K 3 1/4 04/01/26	0	200	0	200 USD	96.21%	192'418.20	0.01	a)
US487836BQ08	4.5000 % K 4 1/2 04/01/46	300	0	0	300 USD	85.30%	255'885.00	0.02	a)
US487836BU10	3.4000 % K 3.4 11/15/27	750	0	0	750 USD	94.43%	708'250.50	0.04	a)
US487836BW75	4.3000 % K 4.3 05/15/28	0	200	0	200 USD	97.23%	194'466.80	0.01	a)
US487836BX58	2.1000 % K 2.1 06/01/30	0	200	0	200 USD	84.29%	168'586.60	0.01	a)
US49177JAC62	5.3500 % KVUE 5.35 03/22/26 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAD46	5.3500 % KVUE 5.35 03/22/26	0	200	0	200 USD	100.62%	201'248.20	0.01	a)
US49177JAE29	5.0500 % KVUE 5.05 03/22/28 144A	0	350	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAF93	5.0500 % KVUE 5.05 03/22/28	0	350	0	350 USD	100.49%	351'714.30	0.02	a)
US49177JAG76	5.0000 % KVUE 5 03/22/30 144A	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAH59	5.0000 % KVUE 5 03/22/30	0	300	0	300 USD	100.16%	300'489.30	0.02	a)
US49177JAJ16	4.9000 % KVUE 4.9 03/22/33 144A	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAK88	4.9000 % KVUE 4.9 03/22/33	0	950	0	950 USD	98.48%	935'551.45	0.06	a)
US49177JAL61	5.1000 % KVUE 5.1 03/22/43 144A	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAM45	5.1000 % KVUE 5.1 03/22/43	0	200	0	200 USD	97.31%	194'610.40	0.01	a)
US49177JAN28	5.0500 % KVUE 5.05 03/22/53 144A	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAP75	5.0500 % KVUE 5.05 03/22/53	0	500	0	500 USD	96.26%	481'319.00	0.03	a)
US49177JAQ58	5.2000 % KVUE 5.2 03/22/63 144A	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49177JAR32	5.2000 % KVUE 5.2 03/22/63	0	250	0	250 USD	96.97%	242'413.25	0.02	a)
US49271VAF76	4.5970 % KDP 4.597 05/25/28	500	0	0	500 USD	98.70%	493'507.50	0.03	a)
US49271VAH33	4.4170 % KDP 4.417 05/25/25	120	0	0	120 USD	98.94%	118'732.80	0.01	a)
US49271VAJ98	3.2000 % KDP 3.2 05/01/30	500	0	0	500 USD	90.13%	450'674.00	0.03	a)
US49271VAK61	3.8000 % KDP 3.8 05/01/50	0	250	0	250 USD	76.24%	190'589.25	0.01	a)
US49271VAM28	3.3500 % KDP 3.35 03/15/51	0	100	0	100 USD	69.59%	69'594.80	0.00	a)
US49271VAQ32	4.0500 % KDP 4.05 04/15/32	500	0	0	500 USD	92.68%	463'397.50	0.03	a)
US49271VAR15	4.5000 % KDP 4 1/2 04/15/52	500	0	0	500 USD	84.50%	422'518.00	0.03	a)
US49326EEG44	4.1000 % KEY 4.1 04/30/28 MTN	0	200	0	200 USD	93.53%	187'056.60	0.01	a)
US49326EEK55	2.2500 % KEY 2 1/4 04/06/27 MTN	300	0	0	300 USD	89.13%	267'377.40	0.02	a)
US49326EEN94	4.7890 % KEY 4.789 06/01/33 MTN	500	0	0	500 USD	90.25%	451'274.50	0.03	a)
US49327M2K91	3.3000 % KEY 3.3 06/01/25 BKNT	300	0	0	300 USD	96.28%	288'829.20	0.02	a)
US49327M3E23	4.1500 % KEY 4.15 08/08/25 BKNT	250	0	0	250 USD	96.80%	241'997.50	0.02	a)
US49327M3F97	5.8500 % KEY 5.85 11/15/27 BKNT	500	0	0	500 USD	98.59%	492'973.50	0.03	a)
US49327V2C76	4.9000 % KEY 4.9 08/08/32 BKNT	0	250	0	250 USD	87.90%	219'737.50	0.01	a)
US49338LAB99	4.5500 % KEYS 4.55 10/30/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US49338LAE39	4.6000 % KEYS 4.6 04/06/27	500	0	0	500 USD	98.25%	491'247.00	0.03	a)
US494368CA98	2.8750 % KMB 2 7/8 02/07/50	500	0	0	500 USD	68.23%	341'139.00	0.02	a)
US494368CB71	3.1000 % KMB 3.1 03/26/30	1'000	0	0	1'000 USD	90.96%	909'613.00	0.06	a)
US494368CC54	1.0500 % KMB 1.05 09/15/27	500	0	0	500 USD	87.98%	439'889.00	0.03	a)
US49446RAU32	3.3000 % KIM 3.3 02/01/25	550	0	0	550 USD	97.80%	537'886.25	0.03	a)
US49446RAY53	2.2500 % KIM 2 1/4 12/01/31	0	150	0	150 USD	79.72%	119'575.65	0.01	a)
US49446RAZ29	3.2000 % KIM 3.2 04/01/32	0	150	0	150 USD	84.87%	127'307.55	0.01	a)
US49446RBA68	4.6000 % KIM 4.6 02/01/33	500	0	0	500 USD	93.39%	466'952.50	0.03	a)
US49447BAA17	6.4000 % KIM 6.4 03/01/34	0	200	0	200 USD	105.23%	210'457.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US494550AQ90	7.3000 % KMI 7.3 08/15/33	250	0	0	250 USD	111.11%	277'770.00	0.02	a)
US494550AW68	6.9500 % KMI 6.95 01/15/38 MTN	300	0	0	300 USD	108.51%	325'535.40	0.02	a)
US494550BH82	6.3750 % KMI 6 3/8 03/01/41	300	0	0	300 USD	101.46%	304'392.90	0.02	a)
US494550BN50	5.0000 % KMI 5 08/15/42	150	0	0	150 USD	87.52%	131'273.55	0.01	a)
US49456BAF85	4.3000 % KMI 4.3 06/01/25	400	0	0	400 USD	98.56%	394'236.00	0.02	a)
US49456BAG68	5.3000 % KMI 5.3 12/01/34	200	0	0	200 USD	97.72%	195'435.20	0.01	a)
US49456BAH42	5.5500 % KMI 5.55 06/01/45	700	0	0	700 USD	94.26%	659'817.90	0.04	a)
US49456BAJ08	5.0500 % KMI 5.05 02/15/46	350	0	0	350 USD	87.03%	304'588.20	0.02	a)
US49456BAP67	4.3000 % KMI 4.3 03/01/28	400	0	0	400 USD	97.17%	388'679.20	0.02	a)
US49456BAQ41	5.2000 % KMI 5.2 03/01/48	400	0	0	400 USD	88.81%	355'227.60	0.02	a)
US49456BAT89	3.6000 % KMI 3.6 02/15/51	200	0	0	200 USD	68.75%	137'505.20	0.01	a)
US49456BAW19	5.4500 % KMI 5.45 08/01/52	0	300	0	300 USD	92.25%	276'753.60	0.02	a)
US49456BAX91	5.2000 % KMI 5.2 06/01/33	0	500	0	500 USD	97.07%	485'325.00	0.03	a)
US496902AR81	6.2500 % KCN 6 1/4 07/15/33 144A	0	200	0	200 USD	101.98%	203'968.00	0.01	a)
US497266AC03	4.2000 % KEX 4.2 03/01/28	200	0	0	200 USD	95.53%	191'060.00	0.01	a)
US500472AC95	6.8750 % PHIANA 6 7/8 03/11/38	500	0	0	500 USD	106.61%	533'027.50	0.03	a)
US500472AE51	5.0000 % PHIANA 5 03/15/42	250	0	0	250 USD	89.68%	224'205.75	0.01	a)
US50076QAE61	5.0000 % KHC 5 06/04/42	750	0	0	750 USD	92.41%	693'085.50	0.04	a)
US50076QAN60	6.5000 % KHC 6 1/2 02/09/40	350	0	0	350 USD	107.50%	376'260.85	0.02	a)
US50076QAR74	6.8750 % KHC 6 7/8 01/26/39	500	0	0	500 USD	112.55%	562'743.00	0.04	a)
US50077LAB27	4.3750 % KHC 4 3/8 06/01/46	500	0	0	500 USD	83.00%	414'987.00	0.03	a)
US50077LAD82	3.0000 % KHC 3 06/01/26	3'100	0	0	3'100 USD	95.40%	2'957'474.40	0.18	a)
US50077LAL09	5.0000 % KHC 5 07/15/35	500	0	0	500 USD	97.85%	489'235.50	0.03	a)
US50077LAM81	5.2000 % KHC 5.2 07/15/45	500	0	0	500 USD	93.38%	466'891.50	0.03	a)
US50077LAV80	3.7500 % KHC 3 3/4 04/01/30	500	0	0	500 USD	93.46%	467'307.00	0.03	a)
US50077LAZ94	4.8750 % KHC 4 7/8 10/01/49	0	300	0	300 USD	88.91%	266'740.80	0.02	a)
US50077LBJ44	5.5000 % KHC 5 1/2 06/01/50	0	200	0	200 USD	97.92%	195'834.40	0.01	a)
US501044DE89	2.6500 % KR 2.65 10/15/26	250	0	0	250 USD	93.78%	234'455.50	0.01	a)
US501044DF54	3.8750 % KR 3 7/8 10/15/46	300	0	0	300 USD	76.09%	228'274.50	0.01	a)
US501044DG38	4.4500 % KR 4.45 02/01/47	250	0	0	250 USD	84.70%	211'739.75	0.01	a)
US501044DK40	4.6500 % KR 4.65 01/15/48	200	0	0	200 USD	87.21%	174'413.80	0.01	a)
US501044DM06	5.4000 % KR 5.4 01/15/49	0	200	0	200 USD	97.43%	194'869.60	0.01	a)
US501044DN88	3.9500 % KR 3.95 01/15/50	0	320	0	320 USD	78.27%	250'464.96	0.02	a)
US501044DP37	2.2000 % KR 2.2 05/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	84.03%	840'337.00	0.05	a)
US50155QAL41	3.1500 % KD 3.15 10/15/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US501889AD16	5.7500 % LKQ 5 3/4 06/15/28	0	250	0	250 USD	101.08%	252'694.50	0.02	a)
US501889AF63	6.2500 % LKQ 6 1/4 06/15/33	0	200	0	200 USD	102.59%	205'187.60	0.01	a)
US50212YAH71	6.7500 % LPLA 6 3/4 11/17/28	0	300	0	300 USD	104.18%	312'530.10	0.02	a)
US50247VAB53	5.2500 % LYB 5 1/4 07/15/43	400	0	0	400 USD	91.69%	366'747.20	0.02	a)
US50247VAC37	4.8750 % LYB 4 7/8 03/15/44	500	0	0	500 USD	87.94%	439'702.00	0.03	a)
US50247WAB37	3.5000 % LYB 3 1/2 03/02/27	0	250	0	250 USD	95.30%	238'244.00	0.01	a)
US50249AAA16	4.2000 % LYB 4.2 10/15/49	600	0	0	600 USD	77.56%	465'369.00	0.03	a)
US50249AAD54	4.2000 % LYB 4.2 05/01/50	0	200	0	200 USD	77.03%	154'055.80	0.01	a)
US50249AAJ25	3.6250 % LYB 3 5/8 04/01/51	0	200	0	200 USD	70.48%	140'965.00	0.01	a)
US50249AAK97	3.8000 % LYB 3.8 10/01/60	250	0	0	250 USD	67.45%	168'629.00	0.01	a)
US50249AAL70	5.6250 % LYB 5 5/8 05/15/33	0	200	0	200 USD	101.67%	203'349.60	0.01	a)
US50540RAQ56	3.6000 % LH 3.6 02/01/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50540RAS13	4.7000 % LH 4.7 02/01/45	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50540RAU68	3.6000 % LH 3.6 09/01/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US512807AN85	3.8000 % LRCX 3.8 03/15/25	400	0	0	400 USD	98.42%	393'666.00	0.02	a)
US512807AV02	1.9000 % LRCX 1.9 06/15/30	500	0	0	500 USD	83.80%	418'993.00	0.03	a)
US512807AW84	2.8750 % LRCX 2 7/8 06/15/50	500	0	0	500 USD	67.54%	337'702.50	0.02	a)
US512807AX67	3.1250 % LRCX 3 1/8 06/15/60	500	0	0	500 USD	65.33%	326'666.00	0.02	a)
US517834AE74	3.5000 % LVS 3 1/2 08/18/26	400	0	0	400 USD	94.17%	376'661.20	0.02	a)
US517834AF40	3.9000 % LVS 3.9 08/08/29	200	0	0	200 USD	90.74%	181'486.20	0.01	a)
US52107QAJ40	4.5000 % LAZ 4 1/2 09/19/28	300	0	0	300 USD	95.54%	286'625.70	0.02	a)
US521865AY17	3.8000 % LEA 3.8 09/15/27	1'000	0	0	1'000 USD	95.38%	953'752.00	0.06	a)
US524660AY34	3.5000 % LEG 3 1/2 11/15/27	0	150	0	150 USD	93.28%	139'917.75	0.01	a)
US524660AZ09	4.4000 % LEG 4.4 03/15/29	0	150	0	150 USD	94.52%	141'780.00	0.01	a)
US524660BA49	3.5000 % LEG 3 1/2 11/15/51	0	250	0	250 USD	68.35%	170'873.50	0.01	a)
US526107AG24	5.5000 % LII 5 1/2 09/15/28	0	200	0	200 USD	100.69%	201'377.80	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US532457BH00	2.7500 % LLY 2 3/4 06/01/25	250	0	0	250 USD	97.14%	242'859.50	0.02	a)
US532457BU11	4.1500 % LLY 4.15 03/15/59	250	0	0	250 USD	83.42%	208'547.25	0.01	a)
US532457BV93	3.3750 % LLY 3 3/8 03/15/29	500	0	0	500 USD	94.14%	470'686.50	0.03	a)
US532457BY33	2.2500 % LLY 2 1/4 05/15/50	500	0	0	500 USD	60.89%	304'428.50	0.02	a)
US532457BZ08	2.5000 % LLY 2 1/2 09/15/60	250	0	0	250 USD	57.90%	144'740.75	0.01	a)
US532457CF35	4.7000 % LLY 4.7 02/27/33	0	292	0	292 USD	98.82%	288'542.72	0.02	a)
US532457CG18	4.8750 % LLY 4 7/8 02/27/53	0	400	0	400 USD	97.28%	389'138.80	0.02	a)
US532457CH90	4.9500 % LLY 4.95 02/27/63	0	250	0	250 USD	96.97%	242'413.00	0.02	a)
US534187BA67	7.0000 % LNC 7 06/15/40	250	200	0	450 USD	109.35%	492'068.70	0.03	a)
US534187BH11	3.8000 % LNC 3.8 03/01/28	0	150	0	150 USD	95.10%	142'648.80	0.01	a)
US539439AM10	4.5820 % LLOYDS 4.582 12/10/25	500	0	0	500 USD	98.05%	490'249.50	0.03	a)
US539439AN92	5.3000 % LLOYDS 5.3 12/01/45	300	0	0	300 USD	93.33%	279'989.10	0.02	a)
US539439AQ24	3.5740 % LLOYDS 3.574 11/07/28	400	0	0	400 USD	93.60%	374'395.60	0.02	a)
US539439AR07	4.3750 % LLOYDS 4 3/8 03/22/28	500	0	0	500 USD	96.41%	482'051.00	0.03	a)
US539439AT62	4.5500 % LLOYDS 4.55 08/16/28	500	0	0	500 USD	97.05%	485'231.00	0.03	a)
US539439AW91	7.9530 % LLOYDS 7.953 11/15/33	400	0	0	400 USD	110.93%	443'730.40	0.03	a)
US539439AX74	5.8710 % LLOYDS 5.871 03/06/29	0	500	0	500 USD	100.97%	504'862.00	0.03	a)
US539439AY57	5.9850 % LLOYDS 5.985 08/07/27	0	430	0	430 USD	100.62%	432'675.46	0.03	a)
US53944YAB92	4.6500 % LLOYDS 4.65 03/24/26	450	0	0	450 USD	97.85%	440'332.20	0.03	a)
US53944YAD58	3.7500 % LLOYDS 3 3/4 01/11/27	800	0	0	800 USD	95.75%	766'025.60	0.05	a)
US53944YAE32	4.3440 % LLOYDS 4.344 01/09/48	300	0	0	300 USD	78.57%	235'715.10	0.01	a)
US53944YAF07	4.4500 % LLOYDS 4.45 05/08/25	500	0	0	500 USD	98.74%	493'690.50	0.03	a)
US53944YAH62	3.9000 % LLOYDS 3.9 03/12/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US53944YAL74	3.8700 % LLOYDS 3.87 07/09/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US53944YAP88	1.6270 % LLOYDS 1.627 05/11/27	300	0	0	300 USD	91.74%	275'213.10	0.02	a)
US53944YAR45	3.5110 % LLOYDS 3.511 03/18/26	0	200	0	200 USD	97.68%	195'355.00	0.01	a)
US53944YAS28	3.7500 % LLOYDS 3 3/4 03/18/28	200	0	0	200 USD	94.48%	188'957.00	0.01	a)
US53944YAU73	4.9760 % LLOYDS 4.976 08/11/33	400	0	0	400 USD	95.17%	380'675.60	0.02	a)
US548661CX31	4.6500 % LOW 4.65 04/15/42	250	0	0	250 USD	89.56%	223'888.25	0.01	a)
US548661DH71	3.3750 % LOW 3 3/8 09/15/25	250	0	0	250 USD	97.23%	243'072.00	0.02	a)
US548661DM66	2.5000 % LOW 2 1/2 04/15/26	500	0	0	500 USD	94.83%	474'137.00	0.03	a)
US548661DN40	3.7000 % LOW 3.7 04/15/46	550	0	0	550 USD	75.24%	413'818.35	0.03	a)
US548661DP97	3.1000 % LOW 3.1 05/03/27	500	0	0	500 USD	94.55%	472'759.50	0.03	a)
US548661DQ70	4.0500 % LOW 4.05 05/03/47	450	0	0	450 USD	78.97%	355'371.75	0.02	a)
US548661DR53	3.6500 % LOW 3.65 04/05/29	400	0	0	400 USD	94.23%	376'900.80	0.02	a)
US548661DU82	4.5000 % LOW 4 1/2 04/15/30	500	0	0	500 USD	97.34%	486'723.50	0.03	a)
US548661DX22	1.3000 % LOW 1.3 04/15/28	400	0	0	400 USD	86.66%	346'636.80	0.02	a)
US548661DZ79	3.0000 % LOW 3 10/15/50	700	0	0	700 USD	64.37%	450'613.10	0.03	a)
US548661EA10	2.6250 % LOW 2 5/8 04/01/31	1'250	0	0	1'250 USD	85.11%	1'063'821.25	0.07	a)
US548661EB92	3.5000 % LOW 3 1/2 04/01/51	0	140	0	140 USD	70.25%	98'344.40	0.01	a)
US548661ED58	1.7000 % LOW 1.7 09/15/28	300	0	0	300 USD	86.78%	260'343.90	0.02	a)
US548661EE32	2.8000 % LOW 2.8 09/15/41	0	250	0	250 USD	69.45%	173'617.00	0.01	a)
US548661EF07	4.4500 % LOW 4.45 04/01/62	500	0	0	500 USD	79.64%	398'215.00	0.02	a)
US548661EG89	3.3500 % LOW 3.35 04/01/27	500	0	0	500 USD	95.32%	476'593.50	0.03	a)
US548661EH62	3.7500 % LOW 3 3/4 04/01/32	400	0	0	400 USD	90.56%	362'222.80	0.02	a)
US548661EJ29	4.2500 % LOW 4 1/4 04/01/52	500	0	0	500 USD	80.28%	401'414.50	0.03	a)
US548661EK91	4.4000 % LOW 4.4 09/08/25	200	0	0	200 USD	98.71%	197'417.40	0.01	a)
US548661EM57	5.6250 % LOW 5 5/8 04/15/53	300	300	0	600 USD	98.86%	593'133.00	0.04	a)
US548661EN31	5.8000 % LOW 5.8 09/15/62	0	300	0	300 USD	99.83%	299'499.60	0.02	a)
US548661EP88	4.8000 % LOW 4.8 04/01/26	0	310	0	310 USD	99.28%	307'761.18	0.02	a)
US548661EQ61	5.1500 % LOW 5.15 07/01/33	0	250	0	250 USD	99.24%	248'094.50	0.02	a)
US548661ER45	5.7500 % LOW 5 3/4 07/01/53	0	150	0	150 USD	100.99%	151'485.15	0.01	a)
US548661ES28	5.8500 % LOW 5.85 04/01/63	0	155	0	155 USD	100.63%	155'975.26	0.01	a)
US552081AK73	5.7500 % LYB 5 3/4 04/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US552081AM30	4.6250 % LYB 4 5/8 02/26/55	500	0	0	500 USD	82.56%	412'794.50	0.03	a)
US55261FAR55	5.0530 % MTB 5.053 01/27/34	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55279HAK68	2.9000 % MTB 2.9 02/06/25 BKNT	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55279HAQ39	3.4000 % MTB 3.4 08/17/27 BKNT	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US55336VAG59	4.8750 % MPLX 4 7/8 12/01/24	750	0	0	750 USD	99.45%	745'837.50	0.05	a)
US55336VAJ98	4.8750 % MPLX 4 7/8 06/01/25	650	0	0	650 USD	99.05%	643'828.90	0.04	a)
US55336VAK61	4.1250 % MPLX 4 1/8 03/01/27	500	0	0	500 USD	96.95%	484'774.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US55336VAL45	5.2000 % MPLX 5.2 03/01/47	250	0	0	250 USD	90.00%	225'005.75	0.01	a)
US55336VAM28	4.5000 % MPLX 4 1/2 04/15/38	800	0	0	800 USD	87.14%	697'123.20	0.04	a)
US55336VAN01	4.7000 % MPLX 4.7 04/15/48	500	0	0	500 USD	83.85%	419'234.50	0.03	a)
US55336VAP58	4.9000 % MPLX 4.9 04/15/58	0	150	0	150 USD	82.48%	123'715.80	0.01	a)
US55336VAR15	4.0000 % MPLX 4 03/15/28	500	0	0	500 USD	95.76%	478'793.50	0.03	a)
US55336VAS97	4.8000 % MPLX 4.8 02/15/29	0	200	0	200 USD	98.10%	196'196.20	0.01	a)
US55336VAT70	5.5000 % MPLX 5 1/2 02/15/49	500	0	0	500 USD	93.81%	469'046.00	0.03	a)
US55336VBQ23	2.6500 % MPLX 2.65 08/15/30	0	300	0	300 USD	85.03%	255'102.00	0.02	a)
US55336VBT61	4.9500 % MPLX 4.95 03/14/52	400	0	0	400 USD	85.86%	343'455.20	0.02	a)
US55336VBU35	4.9500 % MPLX 4.95 09/01/32	0	200	0	200 USD	95.68%	191'358.40	0.01	a)
US55336VBV18	5.0000 % MPLX 5 03/01/33	0	300	0	300 USD	95.72%	287'170.20	0.02	a)
US55336VBW90	5.6500 % MPLX 5.65 03/01/53	0	200	0	200 USD	95.69%	191'380.20	0.01	a)
US55903VAZ67	3.6380 % WBD 3.638 03/15/25	0	500	0	500 USD	97.91%	489'547.00	0.03	a)
US55903VBA08	3.7550 % WBD 3.755 03/15/27	0	1'250	0	1'250 USD	94.70%	1'183'697.50	0.07	a)
US55903VBB80	4.0540 % WBD 4.054 03/15/29	0	500	0	500 USD	92.57%	462'854.00	0.03	a)
US55903VBC63	4.2790 % WBD 4.279 03/15/32	0	1'850	0	1'850 USD	88.09%	1'629'642.80	0.10	a)
US55903VBD47	5.0500 % WBD 5.05 03/15/42	0	1'800	0	1'800 USD	83.63%	1'505'383.20	0.09	a)
US55903VBE20	5.1410 % WBD 5.141 03/15/52	0	2'200	0	2'200 USD	80.84%	1'778'473.40	0.11	a)
US55903VBF94	5.3910 % WBD 5.391 03/15/62	0	920	0	920 USD	80.01%	736'093.84	0.05	a)
US55903VBG77	6.4120 % WBD 6.412 03/15/26	0	600	0	600 USD	99.77%	598'606.80	0.04	a)
US559080AG18	5.1500 % OKE 5.15 10/15/43	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559080AK20	5.0000 % OKE 5 03/01/26	250	0	0	250 USD	99.39%	248'468.25	0.02	a)
US559080AL03	4.2500 % OKE 4 1/4 09/15/46	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559080AN68	4.8500 % OKE 4.85 02/01/49	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559080AP17	3.9500 % OKE 3.95 03/01/50	0	300	0	300 USD	73.12%	219'360.30	0.01	a)
US559080AQ99	3.2500 % OKE 3 1/4 06/01/30	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559222AQ72	3.6250 % MGCN 3 5/8 06/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US559222AR55	4.1500 % MGCN 4.15 10/01/25	250	0	0	250 USD	98.17%	245'436.00	0.02	a)
US559222AV67	2.4500 % MGCN 2.45 06/15/30	250	0	0	250 USD	85.42%	213'546.50	0.01	a)
US56035LAE48	3.0000 % MAIN 3 07/14/26	400	0	0	400 USD	92.40%	369'604.00	0.02	a)
US56501RAC07	4.1500 % MFCCN 4.15 03/04/26	600	0	0	600 USD	97.80%	586'780.20	0.04	a)
US56501RAD89	5.3750 % MFCCN 5 3/8 03/04/46	400	0	0	400 USD	97.77%	391'096.80	0.02	a)
US56501RAN61	3.7030 % MFCCN 3.703 03/16/32	300	0	0	300 USD	90.89%	272'655.90	0.02	a)
US565849AB20	6.8000 % MRO 6.8 03/15/32	250	0	0	250 USD	106.68%	266'690.50	0.02	a)
US565849AE68	6.6000 % MRO 6.6 10/01/37	350	0	0	350 USD	103.47%	362'158.30	0.02	a)
US56585AAF93	6.5000 % MPC 6 1/2 03/01/41	350	0	0	350 USD	105.79%	370'250.65	0.02	a)
US56585AAH59	4.7500 % MPC 4 3/4 09/15/44	500	0	0	500 USD	87.34%	436'702.00	0.03	a)
US56585ABC53	5.1250 % MPC 5 1/8 12/15/26	500	0	0	500 USD	99.57%	497'864.50	0.03	a)
US571748AV42	3.5000 % MMC 3 1/2 06/03/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571748AX08	3.5000 % MMC 3 1/2 03/10/25	500	0	0	500 USD	98.30%	491'523.50	0.03	a)
US571748BC51	4.3500 % MMC 4.35 01/30/47	200	0	0	200 USD	84.90%	169'803.60	0.01	a)
US571748BG65	4.3750 % MMC 4 3/8 03/15/29	400	0	0	400 USD	97.66%	390'646.80	0.02	a)
US571748BH49	4.7500 % MMC 4 3/4 03/15/39	0	200	0	200 USD	94.21%	188'422.40	0.01	a)
US571748BJ05	4.9000 % MMC 4.9 03/15/49	700	0	0	700 USD	92.93%	650'496.00	0.04	a)
US571748BR21	5.7500 % MMC 5 3/4 11/01/32	250	0	0	250 USD	104.04%	260'091.00	0.02	a)
US571748BS04	6.2500 % MMC 6 1/4 11/01/52	0	150	0	150 USD	111.01%	166'518.90	0.01	a)
US571748BT86	5.4500 % MMC 5.45 03/15/53	0	200	0	200 USD	99.57%	199'139.00	0.01	a)
US571748BU59	5.4000 % MMC 5.4 09/15/33	0	150	0	150 USD	101.59%	152'389.95	0.01	a)
US571748BV33	5.7000 % MMC 5.7 09/15/53	0	250	0	250 USD	103.70%	259'239.75	0.02	a)
US571903BD44	5.7500 % MAR 5 3/4 05/01/25 EE	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BE27	4.6250 % MAR 4 5/8 06/15/30 FF	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BF91	3.5000 % MAR 3 1/2 10/15/32 GG	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BG74	2.8500 % MAR 2.85 04/15/31 HH	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BH57	2.7500 % MAR 2 3/4 10/15/33 II	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US571903BN26	5.5500 % MAR 5.55 10/15/28	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US573284AW62	2.4000 % MLM 2.4 07/15/31	400	0	0	400 USD	82.97%	331'898.40	0.02	a)
US573284AX46	3.2000 % MLM 3.2 07/15/51	500	0	0	500 USD	68.99%	344'946.50	0.02	a)
US573874AC88	1.6500 % MRVL 1.65 04/15/26	0	160	0	160 USD	92.63%	148'200.00	0.01	a)
US573874AF10	2.4500 % MRVL 2.45 04/15/28	0	230	0	230 USD	89.63%	206'137.50	0.01	a)
US573874AJ32	2.9500 % MRVL 2.95 04/15/31	0	230	0	230 USD	85.38%	196'362.50	0.01	a)
US573874AP91	5.7500 % MRVL 5 3/4 02/15/29	0	160	0	160 USD	101.75%	162'800.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US573874AQ74	5.9500 % MRVL 5.95 09/15/33	0	160	0	160 USD	103.25%	165'200.00	0.01	a)
US574599BQ83	2.0000 % MAS 2 02/15/31	300	0	0	300 USD	81.02%	243'054.00	0.02	a)
US574599BS40	1.5000 % MAS 1 1/2 02/15/28	300	0	0	300 USD	86.70%	260'101.80	0.02	a)
US575718AA93	5.6000 % MASSIN 5.6 07/01/2111	0	200	0	200 USD	106.97%	213'947.20	0.01	a)
US575718AB76	4.6780 % MASSIN 4.678 07/01/2114	0	150	0	150 USD	90.21%	135'317.70	0.01	a)
US575718AG63	2.9890 % MASSIN 2.989 07/01/50 F	400	0	0	400 USD	71.88%	287'538.40	0.02	a)
US57636QAB05	3.3750 % MA 3 3/8 04/01/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57636QAG91	2.9500 % MA 2.95 11/21/26	200	0	0	200 USD	95.41%	190'817.80	0.01	a)
US57636QAH74	3.8000 % MA 3.8 11/21/46	250	0	0	250 USD	82.74%	206'838.75	0.01	a)
US57636QAK04	3.9500 % MA 3.95 02/26/48	0	200	0	200 USD	84.89%	169'782.60	0.01	a)
US57636QAL86	3.6500 % MA 3.65 06/01/49	500	0	0	500 USD	79.82%	399'115.00	0.02	a)
US57636QAM69	2.9500 % MA 2.95 06/01/29	1'000	0	0	1'000 USD	91.79%	917'903.00	0.06	a)
US57636QAP90	3.3500 % MA 3.35 03/26/30	500	0	0	500 USD	92.36%	461'776.50	0.03	a)
US57636QAQ73	3.8500 % MA 3.85 03/26/50	500	0	0	500 USD	82.50%	412'495.50	0.03	a)
US57636QAT13	2.9500 % MA 2.95 03/15/51	0	125	0	125 USD	69.35%	86'683.25	0.01	a)
US57636QAW42	4.8750 % MA 4 7/8 03/09/28	0	250	0	250 USD	101.40%	253'511.75	0.02	a)
US57636QAX25	4.8500 % MA 4.85 03/09/33	0	200	0	200 USD	99.73%	199'465.40	0.01	a)
US579780AN77	3.4000 % MKC 3.4 08/15/27	250	0	0	250 USD	94.66%	236'656.25	0.01	a)
US579780AQ09	2.5000 % MKC 2 1/2 04/15/30	0	150	0	150 USD	85.58%	128'364.15	0.01	a)
US579780AR81	0.9000 % MKC 0.9 02/15/26	250	0	0	250 USD	91.91%	229'774.75	0.01	a)
US579780AS64	1.8500 % MKC 1.85 02/15/31	200	0	0	200 USD	80.34%	160'687.20	0.01	a)
US579780AT48	4.9500 % MKC 4.95 04/15/33	0	140	0	140 USD	97.67%	136'732.82	0.01	a)
US58013MEC47	6.3000 % MCD 6.3 10/15/37 MTN	30	210	0	240 USD	108.92%	261'400.56	0.02	a)
US58013MEF77	6.3000 % MCD 6.3 03/01/38 MTN	200	0	0	200 USD	108.86%	217'715.00	0.01	a)
US58013MENO2	3.7000 % MCD 3.7 02/15/42 MTN	380	0	0	380 USD	80.04%	304'136.42	0.02	a)
US58013MER16	3.6250 % MCD 3 5/8 05/01/43 MTN	500	0	0	500 USD	78.57%	392'845.00	0.02	a)
US58013MES98	3.2500 % MCD 3 1/4 06/10/24 MTN	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58013MEU45	3.3750 % MCD 3 3/8 05/26/25 MTN	1'050	0	0	1'050 USD	97.66%	1'025'422.65	0.06	a)
US58013MEV28	4.6000 % MCD 4.6 05/26/45 MTN	200	0	0	200 USD	88.89%	177'779.60	0.01	a)
US58013MFA71	4.8750 % MCD 4 7/8 12/09/45 MTN	750	0	0	750 USD	91.92%	689'387.25	0.04	a)
US58013MFB54	3.5000 % MCD 3 1/2 03/01/27 MTN	500	0	0	500 USD	96.18%	480'901.50	0.03	a)
US58013MFC38	4.4500 % MCD 4.45 03/01/47 MTN	0	200	0	200 USD	85.84%	171'671.60	0.01	a)
US58013MFF68	3.8000 % MCD 3.8 04/01/28 MTN	500	0	0	500 USD	96.00%	479'983.50	0.03	a)
US58013MFH25	4.4500 % MCD 4.45 09/01/48 MTN	0	219	0	219 USD	86.24%	188'870.86	0.01	a)
US58013MFK53	3.6250 % MCD 3 5/8 09/01/49 MTN	500	0	0	500 USD	74.98%	374'917.50	0.02	a)
US58013MFM10	2.1250 % MCD 2 1/8 03/01/30 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	85.52%	855'188.00	0.05	a)
US58013MFS89	4.6000 % MCD 4.6 09/09/32 MTN	0	200	0	200 USD	97.62%	195'237.80	0.01	a)
US58013MFT62	5.1500 % MCD 5.15 09/09/52 MTN	300	0	0	300 USD	94.98%	284'932.50	0.02	a)
US58013MFU36	4.8000 % MCD 4.8 08/14/28	0	200	0	200 USD	99.71%	199'411.60	0.01	a)
US58013MFV19	4.9500 % MCD 4.95 08/14/33	0	175	0	175 USD	99.16%	173'532.28	0.01	a)
US58013MFW91	5.4500 % MCD 5.45 08/14/53	0	330	0	330 USD	99.59%	328'646.34	0.02	a)
US581557BS37	5.2500 % MCK 5 1/4 02/15/26	0	500	0	500 USD	99.59%	497'943.50	0.03	a)
US581557BU82	5.1000 % MCK 5.1 07/15/33	0	250	0	250 USD	99.73%	249'333.25	0.02	a)
US582839AG14	4.6000 % RKTLN 4.6 06/01/44	650	0	0	650 USD	89.69%	583'009.05	0.04	a)
US585055BT26	4.3750 % MDT 4 3/8 03/15/35	500	0	0	500 USD	94.41%	472'052.00	0.03	a)
US585055BU98	4.6250 % MDT 4 5/8 03/15/45	500	0	0	500 USD	93.00%	464'998.00	0.03	a)
US58507LBB45	4.2500 % MDT 4 1/4 03/30/28	0	300	0	300 USD	97.50%	292'487.10	0.02	a)
US589331AS67	3.6000 % MRK 3.6 09/15/42	150	0	0	150 USD	80.06%	120'085.80	0.01	a)
US58933YAJ47	4.1500 % MRK 4.15 05/18/43	300	0	0	300 USD	86.13%	258'379.20	0.02	a)
US58933YAR62	2.7500 % MRK 2 3/4 02/10/25	900	0	0	900 USD	97.84%	880'518.60	0.05	a)
US58933YAT29	3.7000 % MRK 3.7 02/10/45	900	0	0	900 USD	80.06%	720'501.30	0.04	a)
US58933YAX31	3.4000 % MRK 3.4 03/07/29	750	0	0	750 USD	94.02%	705'126.75	0.04	a)
US58933YAY14	0.7500 % MRK 0 3/4 02/24/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.44%	924'355.00	0.06	a)
US58933YAZ88	1.4500 % MRK 1.45 06/24/30	500	0	0	500 USD	81.76%	408'802.50	0.03	a)
US58933YBA29	2.3500 % MRK 2.35 06/24/40	1'000	0	0	1'000 USD	69.47%	694'746.00	0.04	a)
US58933YBB02	2.4500 % MRK 2.45 06/24/50	0	200	0	200 USD	61.83%	123'666.40	0.01	a)
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	500	0	0	500 USD	63.87%	319'355.00	0.02	a)
US58933YBG98	2.9000 % MRK 2.9 12/10/61	300	0	0	300 USD	61.89%	185'670.90	0.01	a)
US58933YBH71	4.0500 % MRK 4.05 05/17/28	0	200	0	200 USD	97.64%	195'273.80	0.01	a)
US58933YBJ38	4.3000 % MRK 4.3 05/17/30	0	200	0	200 USD	97.29%	194'577.40	0.01	a)
US58933YBK01	4.5000 % MRK 4 1/2 05/17/33	0	400	0	400 USD	97.34%	389'379.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US58933YBM66	5.0000 % MRK 5 05/17/53	0	595	0	595 USD	97.13%	577'941.35	0.04	a)
US58933YBN40	5.1500 % MRK 5.15 05/17/63	0	250	0	250 USD	98.00%	244'998.00	0.02	a)
US59022CAJ27	6.1100 % BAC 6.11 01/29/37	300	0	0	300 USD	105.02%	315'045.90	0.02	a)
US59023VAA89	7.7500 % BAC 7 3/4 05/14/38	780	0	0	780 USD	120.82%	942'417.84	0.06	a)
US59156RAE80	6.5000 % MET 6 1/2 12/15/32	500	0	0	500 USD	109.92%	549'603.00	0.03	a)
US59156RAM07	5.7000 % MET 5.7 06/15/35	300	400	0	700 USD	103.13%	721'920.50	0.05	a)
US59156RAP38	6.4000 % MET 6.4 12/15/36	500	0	0	500 USD	100.85%	504'267.50	0.03	a)
US59156RBD98	4.1250 % MET 4 1/8 08/13/42	300	0	0	300 USD	84.80%	254'392.20	0.02	a)
US59156RBH03	3.6000 % MET 3.6 04/10/24	1'055	0	1'055	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59156RBN70	4.0500 % MET 4.05 03/01/45	500	0	0	500 USD	82.02%	410'082.50	0.03	a)
US59156RBR84	4.6000 % MET 4.6 05/13/46	500	0	0	500 USD	89.03%	445'168.00	0.03	a)
US59156RBZ01	4.5500 % MET 4.55 03/23/30	500	0	0	500 USD	97.93%	489'661.00	0.03	a)
US59156RCD89	5.2500 % MET 5 1/4 01/15/54	0	350	0	350 USD	96.46%	337'604.75	0.02	a)
US59156RCE62	5.3750 % MET 5 3/8 07/15/33	0	280	0	280 USD	100.26%	280'714.00	0.02	a)
US594918BB90	2.7000 % MSFT 2.7 02/12/25	550	0	0	550 USD	97.81%	537'967.10	0.03	a)
US594918BC73	3.5000 % MSFT 3 1/2 02/12/35	555	0	0	555 USD	90.77%	503'760.18	0.03	a)
US594918BJ27	3.1250 % MSFT 3 1/8 11/03/25	850	250	0	1'100 USD	97.22%	1'069'398.00	0.07	a)
US594918BK99	4.2000 % MSFT 4.2 11/03/35	250	0	0	250 USD	95.94%	239'859.50	0.01	a)
US594918BR43	2.4000 % MSFT 2.4 08/08/26	1'200	0	0	1'200 USD	94.63%	1'135'555.20	0.07	a)
US594918BS26	3.4500 % MSFT 3.45 08/08/36	450	0	0	450 USD	88.09%	396'391.50	0.02	a)
US594918BX11	2.8750 % MSFT 2 7/8 02/06/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US594918BY93	3.3000 % MSFT 3.3 02/06/27	1'000	0	0	1'000 USD	96.68%	966'832.00	0.06	a)
US594918BZ68	4.1000 % MSFT 4.1 02/06/37	700	0	0	700 USD	94.14%	658'996.10	0.04	a)
US594918CC64	2.5250 % MSFT 2.525 06/01/50	3'840	0	0	3'840 USD	64.25%	2'467'284.48	0.15	a)
US594918CD48	2.6750 % MSFT 2.675 06/01/60	1'837	0	0	1'837 USD	63.04%	1'158'019.08	0.07	a)
US594918CE21	2.9210 % MSFT 2.921 03/17/52	1'500	350	0	1'850 USD	69.07%	1'277'796.85	0.08	a)
US594918CF95	3.0410 % MSFT 3.041 03/17/62	700	0	0	700 USD	68.25%	477'741.60	0.03	a)
US595017BA15	4.2500 % MCHP 4 1/4 09/01/25	500	0	0	500 USD	98.49%	492'448.00	0.03	a)
US595112BN22	5.3270 % MU 5.327 02/06/29	500	0	0	500 USD	99.75%	498'750.00	0.03	a)
US595112BP79	4.1850 % MU 4.185 02/15/27	800	0	0	800 USD	96.75%	774'000.00	0.05	a)
US595112BS19	2.7030 % MU 2.703 04/15/32	1'000	0	0	1'000 USD	82.04%	820'414.00	0.05	a)
US595112CB74	5.8750 % MU 5 7/8 09/15/33	0	200	0	200 USD	101.68%	203'354.20	0.01	a)
US595620AT22	3.6500 % BRKHEC 3.65 04/15/29	250	500	0	750 USD	94.37%	707'761.50	0.04	a)
US595620AU94	4.2500 % BRKHEC 4 1/4 07/15/49	250	500	0	750 USD	84.15%	631'150.50	0.04	a)
US595620AV77	3.1500 % BRKHEC 3.15 04/15/50	250	0	0	250 USD	69.19%	172'966.75	0.01	a)
US606822AD62	3.8500 % MUFG 3.85 03/01/26	0	1'300	0	1'300 USD	97.54%	1'268'077.20	0.08	a)
US606822AR58	3.2870 % MUFG 3.287 07/25/27	0	540	0	540 USD	94.61%	510'911.82	0.03	a)
US606822AV60	3.9610 % MUFG 3.961 03/02/28	0	140	0	140 USD	96.20%	134'678.04	0.01	a)
US606822BB97	4.2860 % MUFG 4.286 07/26/38	0	350	0	350 USD	92.77%	324'704.80	0.02	a)
US606822BE37	4.1530 % MUFG 4.153 03/07/39	0	350	0	350 USD	90.01%	315'042.00	0.02	a)
US606822BH67	3.7410 % MUFG 3.741 03/07/29	0	200	0	200 USD	94.34%	188'688.00	0.01	a)
US606822BK96	3.7510 % MUFG 3.751 07/18/39	0	800	0	800 USD	85.43%	683'429.60	0.04	a)
US606822BM52	3.1950 % MUFG 3.195 07/18/29	0	400	0	400 USD	90.85%	363'415.20	0.02	a)
US606822BN36	2.1930 % MUFG 2.193 02/25/25	0	800	0	800 USD	96.88%	775'048.80	0.05	a)
US606822BS23	1.4120 % MUFG 1.412 07/17/25	0	500	0	500 USD	94.76%	473'796.50	0.03	a)
US606822BU78	2.0480 % MUFG 2.048 07/17/30	0	500	0	500 USD	83.09%	415'425.50	0.03	a)
US606822BX18	2.3090 % MUFG 2.309 07/20/32	0	400	0	400 USD	81.34%	325'379.20	0.02	a)
US606822BY90	1.5380 % MUFG 1.538 07/20/27	0	800	0	800 USD	91.10%	728'767.20	0.05	a)
US606822CC61	2.3410 % MUFG 2.341 01/19/28	0	350	0	350 USD	91.95%	321'818.35	0.02	a)
US606822CD45	2.8520 % MUFG 2.852 01/19/33	0	300	0	300 USD	83.96%	251'866.80	0.02	a)
US606822CE28	4.0800 % MUFG 4.08 04/19/28	0	250	0	250 USD	96.67%	241'682.25	0.02	a)
US606822CK87	5.1330 % MUFG 5.133 07/20/33	0	600	0	600 USD	98.41%	590'456.40	0.04	a)
US606822CL60	5.0170 % MUFG 5.017 07/20/28	0	690	0	690 USD	99.24%	684'765.66	0.04	a)
US606822CN27	5.3540 % MUFG 5.354 09/13/28	0	350	0	350 USD	100.38%	351'329.65	0.02	a)
US606822CS14	5.4220 % MUFG 5.422 02/22/29	0	300	0	300 USD	100.59%	301'770.30	0.02	a)
US606822CT96	5.4750 % MUFG 5.475 02/22/31	0	200	0	200 USD	100.71%	201'429.40	0.01	a)
US606822CV43	5.7190 % MUFG 5.719 02/20/26	0	500	0	500 USD	100.12%	500'601.50	0.03	a)
US606822CX09	5.4410 % MUFG 5.441 02/22/34	0	400	0	400 USD	100.83%	403'322.40	0.03	a)
US606822CY81	5.2420 % MUFG 5.242 04/19/29	0	300	0	300 USD	100.27%	300'803.70	0.02	a)
US606822DA96	5.5410 % MUFG 5.541 04/17/26	0	250	0	250 USD	99.89%	249'733.25	0.02	a)
US606822DC52	5.4060 % MUFG 5.406 04/19/34	0	400	0	400 USD	100.76%	403'058.40	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 USD	in % 7)	Kat.
US60687YAG44	2.8390 % MIZUHO 2.839 09/13/26	0	600	0	600 USD	94.02%	564'134.40	0.04	a)
US60687YAK55	3.6630 % MIZUHO 3.663 02/28/27	0	200	0	200 USD	95.57%	181'132.20	0.01	a)
US60687YAM12	3.1700 % MIZUHO 3.17 09/11/27	0	200	0	200 USD	93.51%	187'012.20	0.01	a)
US60687YAR09	4.0180 % MIZUHO 4.018 03/05/28	0	200	0	200 USD	96.00%	191'993.40	0.01	a)
US60687YAZ25	2.5550 % MIZUHO 2.555 09/13/25	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US60687YBE86	2.5910 % MIZUHO 2.591 05/25/31	0	200	0	200 USD	85.18%	170'352.20	0.01	a)
US60687YBH18	2.2010 % MIZUHO 2.201 07/10/31	0	200	0	200 USD	82.74%	165'472.60	0.01	a)
US60687YBL20	1.9790 % MIZUHO 1.979 09/08/31	0	500	0	500 USD	80.67%	403'350.00	0.03	a)
US60687YBP34	1.2340 % MIZUHO 1.234 05/22/27	0	409	0	409 USD	91.35%	373'610.87	0.02	a)
US60687YBS72	1.5540 % MIZUHO 1.554 07/09/27	0	400	0	400 USD	91.54%	366'154.40	0.02	a)
US60687YBT55	2.2600 % MIZUHO 2.26 07/09/32	0	200	0	200 USD	80.90%	161'806.40	0.01	a)
US60687YBU29	2.5640 % MIZUHO 2.564 09/13/31	0	290	0	290 USD	80.93%	234'694.39	0.01	a)
US60687YBX67	3.2610 % MIZUHO 3.261 05/22/30	0	350	0	350 USD	90.60%	317'090.55	0.02	a)
US60687YCL11	5.4140 % MIZUHO 5.414 09/13/28	0	250	0	250 USD	100.37%	250'923.50	0.02	a)
US60687YCM93	5.6690 % MIZUHO 5.669 09/13/33	0	200	0	200 USD	101.11%	202'223.40	0.01	a)
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	0	250	0	250 USD	101.06%	252'657.75	0.02	a)
US60687YCR80	5.7390 % MIZUHO 5.739 05/27/31	0	200	0	200 USD	102.06%	204'116.40	0.01	a)
US60687YCT47	5.7540 % MIZUHO 5.754 05/27/34	0	450	0	450 USD	101.77%	457'960.05	0.03	a)
US60687YCZ07	5.7780 % MIZUHO 5.778 07/06/29	0	400	0	400 USD	101.74%	406'952.00	0.03	a)
US60687YDB20	5.7480 % MIZUHO 5.748 07/06/34	0	350	0	350 USD	101.60%	355'587.05	0.02	a)
US60871RAD26	5.0000 % TAP 5 05/01/42	400	0	0	400 USD	93.19%	372'756.80	0.02	a)
US60871RAG56	3.0000 % TAP 3 07/15/26	800	0	0	800 USD	95.27%	762'129.60	0.05	a)
US60871RAH30	4.2000 % TAP 4.2 07/15/46	500	100	0	600 USD	81.59%	489'524.40	0.03	a)
US609207AT22	2.7500 % MDLZ 2 3/4 04/13/30	500	0	0	500 USD	88.30%	441'523.50	0.03	a)
US609207AU94	1.5000 % MDLZ 1 1/2 05/04/25	500	0	0	500 USD	95.66%	478'312.50	0.03	a)
US609207AW50	2.6250 % MDLZ 2 5/8 09/04/50	0	320	0	320 USD	62.54%	200'130.24	0.01	a)
US609207AX34	1.5000 % MDLZ 1 1/2 02/04/31	0	150	0	150 USD	79.56%	119'338.50	0.01	a)
US609207AY17	1.8750 % MDLZ 1 7/8 10/15/32	300	0	0	300 USD	78.50%	235'495.20	0.01	a)
US609207BA22	2.6250 % MDLZ 2 5/8 03/17/27	0	250	0	250 USD	93.26%	233'148.75	0.01	a)
US609207BB05	3.0000 % MDLZ 3 03/17/32	0	250	0	250 USD	85.98%	214'960.75	0.01	a)
US615369AC97	4.8750 % MCO 4 7/8 02/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US615369AE53	5.2500 % MCO 5 1/4 07/15/44	500	0	0	500 USD	97.86%	489'303.50	0.03	a)
US615369AM79	3.2500 % MCO 3 1/4 01/15/28	200	800	0	1'000 USD	94.07%	940'749.00	0.06	a)
US615369AS40	3.7500 % MCO 3 3/4 03/24/25	200	0	0	200 USD	98.31%	196'613.60	0.01	a)
US615369AX35	3.1000 % MCO 3.1 11/29/61	0	200	0	200 USD	63.78%	127'561.00	0.01	a)
US615369AY18	3.7500 % MCO 3 3/4 02/25/52	500	0	0	500 USD	77.66%	388'318.00	0.02	a)
US615369AZ82	4.2500 % MCO 4 1/4 08/08/32	200	0	0	200 USD	94.52%	189'033.80	0.01	a)
US61690U4T48	4.7540 % MS 4.754 04/21/26 BKNT	0	500	0	500 USD	99.13%	495'650.00	0.03	a)
US61690U7U83	5.4790 % MS 5.479 07/16/25	0	340	0	340 USD	100.36%	341'237.60	0.02	a)
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	0	800	0	800 USD	101.67%	813'394.40	0.05	a)
US61690U8A11	4.9520 % MS 4.952 01/14/28 BKNT	0	450	0	450 USD	99.42%	447'376.05	0.03	a)
US6174467X10	5.0000 % MS 5 11/24/25	1'100	0	0	1'100 USD	99.49%	1'094'359.20	0.07	a)
US6174467Y92	4.3500 % MS 4.35 09/08/26 GMTN	600	0	0	600 USD	97.55%	585'297.00	0.04	a)
US6174468C63	4.0000 % MS 4 07/23/25 GMTN	2'000	0	0	2'000 USD	98.26%	1'965'152.00	0.12	a)
US6174468G77	4.4310 % MS 4.431 01/23/30 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	95.81%	958'141.00	0.06	a)
US6174468J17	2.7200 % MS 2.72 07/22/25 MTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174468L62	2.6990 % MS 2.699 01/22/31 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	86.00%	860'004.00	0.05	a)
US6174468N29	5.5970 % MS 5.597 03/24/51 GMTN	700	0	0	700 USD	103.73%	726'090.40	0.05	a)
US6174468P76	3.6220 % MS 3.622 04/01/31 MTN	1'500	0	0	1'500 USD	90.48%	1'357'236.00	0.08	a)
US6174468Q59	2.1880 % MS 2.188 04/28/26	500	0	0	500 USD	96.26%	481'310.00	0.03	a)
US6174468R33	0.8640 % MS 0.864 10/21/25 I	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US6174468U61	1.7940 % MS 1.794 02/13/32 MTN	1'500	0	0	1'500 USD	79.21%	1'188'105.00	0.07	a)
US6174468Y83	2.8020 % MS 2.802 01/25/52 MTN	800	0	0	800 USD	64.22%	513'798.40	0.03	a)
US617446HD43	7.2500 % MS 7 1/4 04/01/32	910	0	0	910 USD	113.97%	1'037'127.00	0.06	a)
US61744YAK47	3.5910 % MS 3.591 07/22/28	500	0	0	500 USD	94.80%	473'988.50	0.03	a)
US61744YAL20	3.9710 % MS 3.971 07/22/38	0	700	0	700 USD	85.39%	597'699.20	0.04	a)
US61744YAP34	3.7720 % MS 3.772 01/24/29 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	94.04%	940'423.00	0.06	a)
US61744YAR99	4.4570 % MS 4.457 04/22/39	0	400	0	400 USD	90.00%	359'991.60	0.02	a)
US61746BCY02	6.2500 % MS 6 1/4 08/09/26 MTN	850	0	0	850 USD	102.38%	870'228.30	0.05	a)
US61746BDQ68	3.8750 % MS 3 7/8 04/29/24 F	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61746BDZ67	3.8750 % MS 3 7/8 01/27/26 GMTN	950	0	0	950 USD	97.39%	925'251.55	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 USD	in % 7)	Kat.
US61746BEF94	3.6250 % MS 3 5/8 01/20/27	750	0	0	750 USD	96.44%	723'262.50	0.05	a)
US61746BEG77	4.3750 % MS 4 3/8 01/22/47	500	0	0	500 USD	86.28%	431'383.00	0.03	a)
US61747YDU64	4.1000 % MS 4.1 05/22/23 MTN	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61747YDY86	4.3000 % MS 4.3 01/27/45	400	200	0	600 USD	86.50%	518'982.60	0.03	a)
US61747YEC57	1.5120 % MS 1.512 07/20/27 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	91.42%	914'161.00	0.06	a)
US61747YED31	2.2390 % MS 2.239 07/21/32 GMTN	1'000	800	0	1'800 USD	80.22%	1'443'992.40	0.09	a)
US61747YEF88	2.4840 % MS 2.484 09/16/36	0	500	0	500 USD	78.43%	392'143.50	0.02	a)
US61747YEH45	2.5110 % MS 2.511 10/20/32 MTN	500	0	0	500 USD	81.69%	408'446.00	0.03	a)
US61747YEK73	2.4750 % MS 2.475 01/21/28	500	0	0	500 USD	92.57%	462'832.50	0.03	a)
US61747YEL56	2.9430 % MS 2.943 01/21/33	1'000	0	0	1'000 USD	84.01%	840'100.00	0.05	a)
US61747YEQ44	3.6200 % MS 3.62 04/17/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61747YER27	4.2100 % MS 4.21 04/20/28	500	0	0	500 USD	96.30%	481'484.50	0.03	a)
US61747YES00	5.2970 % MS 5.297 04/20/37	0	700	0	700 USD	95.31%	667'146.20	0.04	a)
US61747YET82	4.6790 % MS 4.679 07/17/26	700	0	0	700 USD	98.92%	692'409.90	0.04	a)
US61747YEU55	4.8890 % MS 4.889 07/20/33	700	0	0	700 USD	95.75%	670'243.00	0.04	a)
US61747YEV39	6.2960 % MS 6.296 10/18/28	0	700	0	700 USD	103.45%	724'177.30	0.05	a)
US61747YFY77	6.3420 % MS 6.342 10/18/33	500	0	0	500 USD	106.04%	530'184.00	0.03	a)
US61747YEZ43	5.0500 % MS 5.05 01/28/27	0	400	0	400 USD	99.68%	398'706.80	0.02	a)
US61747YFA82	5.1230 % MS 5.123 02/01/29	0	775	0	775 USD	99.56%	771'590.00	0.05	a)
US61747YFB65	5.9480 % MS 5.948 01/19/38	0	800	0	800 USD	99.33%	794'644.00	0.05	a)
US61747YFD22	5.1640 % MS 5.164 04/20/29 MTN	0	750	0	750 USD	99.40%	745'473.75	0.05	a)
US61747YFE05	5.2500 % MS 5 1/4 04/21/34 MTN	0	900	0	900 USD	98.15%	883'379.70	0.06	a)
US61747YFF79	5.4490 % MS 5.449 07/20/29	0	635	0	635 USD	99.95%	634'679.96	0.04	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	0	705	0	705 USD	99.54%	701'756.30	0.04	a)
US61747YFH36	6.4070 % MS 6.407 11/01/29	0	550	0	550 USD	104.47%	574'585.00	0.04	a)
US61747YFJ91	6.6270 % MS 6.627 11/01/34	0	1'000	0	1'000 USD	108.91%	1'089'081.00	0.07	a)
US61747YFK64	5.1730 % MS 5.173 01/16/30	0	650	0	650 USD	99.45%	646'412.65	0.04	a)
US61747YFL48	5.4660 % MS 5.466 01/18/35	0	700	0	700 USD	99.99%	699'961.50	0.04	a)
US617482V925	6.3750 % MS 6 3/8 07/24/42	820	0	0	820 USD	111.52%	914'496.80	0.06	a)
US61761J3R84	3.1250 % MS 3 1/8 07/27/26 MTN	800	0	0	800 USD	95.29%	762'304.80	0.05	a)
US61761JVL06	3.7000 % MS 3.7 10/23/24 GMTN	1'350	500	1'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61761JZN26	3.9500 % MS 3.95 04/23/27	1'150	0	0	1'150 USD	96.23%	1'106'602.45	0.07	a)
US61772BAB99	1.5930 % MS 1.593 05/04/27	0	500	0	500 USD	92.29%	461'464.50	0.03	a)
US61772BAC72	3.2170 % MS 3.217 04/22/42	750	0	0	750 USD	75.64%	567'276.75	0.04	a)
US61945CAD56	5.4500 % MOS 5.45 11/15/33	250	0	0	250 USD	98.77%	246'936.25	0.02	a)
US61945CAE30	5.6250 % MOS 5 5/8 11/15/43	200	0	0	200 USD	95.66%	191'310.80	0.01	a)
US61945CAG87	4.0500 % MOS 4.05 11/15/27	200	0	0	200 USD	95.92%	191'838.20	0.01	a)
US620076BL24	4.6000 % MSI 4.6 02/23/28	500	0	0	500 USD	97.86%	489'281.00	0.03	a)
US620076BN89	4.6000 % MSI 4.6 05/23/29	1'000	0	0	1'000 USD	96.89%	968'861.00	0.06	a)
US620076BT59	2.3000 % MSI 2.3 11/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	82.12%	821'215.00	0.05	a)
US620076BU23	2.7500 % MSI 2 3/4 05/24/31	200	0	0	200 USD	83.01%	166'021.00	0.01	a)
US628530BC02	5.4000 % VTRS 5.4 11/29/43	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US628530BK28	4.5500 % VTRS 4.55 04/15/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62854AAN46	3.9500 % VTRS 3.95 06/15/26	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62854AAP93	5.2500 % VTRS 5 1/4 06/15/46	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62947QBA58	4.8750 % NXPI 4 7/8 03/01/24	330	0	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62947QBC15	5.5500 % NXPI 5.55 12/01/28	150	0	0	150 USD	100.95%	151'426.20	0.01	a)
US62954HAJ77	2.6500 % NXPI 2.65 02/15/32	250	0	0	250 USD	82.24%	205'608.50	0.01	a)
US62954HAN89	3.2500 % NXPI 3 1/4 11/30/51	100	100	0	200 USD	67.40%	134'797.40	0.01	a)
US62954HAU23	3.2500 % NXPI 3 1/4 05/11/41	500	0	0	500 USD	73.29%	366'459.50	0.02	a)
US62954HAV06	4.3000 % NXPI 4.3 06/18/29	280	0	0	280 USD	95.30%	266'844.20	0.02	a)
US62954HAY45	3.4000 % NXPI 3.4 05/01/30	500	0	0	500 USD	89.37%	446'835.00	0.03	a)
US62954HAZ10	3.8750 % NXPI 3 7/8 06/18/26	300	0	0	300 USD	96.72%	290'166.90	0.02	a)
US62954HBA59	2.5000 % NXPI 2 1/2 05/11/31	109	0	0	109 USD	82.53%	89'961.62	0.01	a)
US62954HBB33	5.0000 % NXPI 5 01/15/33	200	200	0	400 USD	96.79%	387'177.60	0.02	a)
US62954RAA41	3.3800 % NYUHOS 3.38 07/01/55 2020	0	300	0	300 USD	72.00%	215'988.00	0.01	a)
US631103AG34	3.8500 % NDAQ 3.85 06/30/26	450	0	0	450 USD	97.09%	436'895.55	0.03	a)
US631103AM02	3.9500 % NDAQ 3.95 03/07/52	500	0	0	500 USD	76.19%	380'925.50	0.02	a)
US63111XAB73	3.2500 % NDAQ 3 1/4 04/28/50	0	100	0	100 USD	67.83%	67'829.10	0.00	a)
US63111XAD30	1.6500 % NDAQ 1.65 01/15/31	250	0	0	250 USD	79.09%	197'724.25	0.01	a)
US63111XAE13	2.5000 % NDAQ 2 1/2 12/21/40	0	400	0	400 USD	66.82%	267'264.80	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 USD	in % 7)	Kat.
US63111XAH44	5.3500 % NDAQ 5.35 06/28/28	0	400	0	400 USD	100.78%	403'112.80	0.03	a)
US63111XAJ00	5.5500 % NDAQ 5.55 02/15/34	0	350	0	350 USD	101.11%	353'870.65	0.02	a)
US63111XAK72	5.9500 % NDAQ 5.95 08/15/53	0	300	0	300 USD	102.85%	308'547.00	0.02	a)
US63111XAL55	6.1000 % NDAQ 6.1 06/28/63	0	200	0	200 USD	103.56%	207'113.00	0.01	a)
US63253QAD60	5.2000 % NAB 5.2 05/13/25	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63253QAE44	4.9000 % NAB 4.9 06/13/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63254AAP30	3.3750 % NAB 3 3/8 01/14/26	1'450	0	1'450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63254AAS78	2.5000 % NAB 2 1/2 07/12/26 BKNT	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63254ABE73	3.9050 % NAB 3.905 06/09/27	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63254ABG22	5.1320 % NAB 5.132 11/22/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63307A2S34	3.7500 % NACN 3 3/4 06/09/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US63307A2X29	5.6000 % NACN 5.6 12/18/28	0	300	0	300 USD	101.19%	303'555.90	0.02	a)
US636180BQ36	5.5000 % NFG 5 1/2 01/15/26	500	0	0	500 USD	99.65%	498'261.00	0.03	a)
US636180BR19	2.9500 % NFG 2.95 03/01/31	400	0	0	400 USD	83.36%	333'428.40	0.02	a)
US636274AD47	5.6020 % NGGLN 5.602 06/12/28	0	200	0	200 USD	101.29%	202'581.00	0.01	a)
US636274AE20	5.8090 % NGGLN 5.809 06/12/33	0	200	0	200 USD	101.09%	202'189.40	0.01	a)
US637071AK74	3.9500 % NOV 3.95 12/01/42	0	400	0	400 USD	74.73%	298'905.60	0.02	a)
US637417AS53	5.6000 % NNN 5.6 10/15/33	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US637432MS19	4.0230 % NRUC 4.023 11/01/32	1'000	0	0	1'000 USD	92.10%	921'036.00	0.06	a)
US637432ND31	2.8500 % NRUC 2.85 01/27/25	200	0	0	200 USD	97.81%	195'628.00	0.01	a)
US637432NP60	3.4000 % NRUC 3.4 02/07/28	300	0	0	300 USD	94.60%	283'812.30	0.02	a)
US637432NT82	4.3000 % NRUC 4.3 03/15/49	0	100	0	100 USD	83.09%	83'087.00	0.01	a)
US63743HEW88	1.0000 % NRUC 1 06/15/26 MTN	0	150	0	150 USD	91.32%	136'984.35	0.01	a)
US63743HFC16	1.8750 % NRUC 1 7/8 02/07/25 MTN	0	200	0	200 USD	96.78%	193'554.20	0.01	a)
US63743HFF47	5.4500 % NRUC 5.45 10/30/25	0	150	0	150 USD	100.38%	150'565.35	0.01	a)
US63743HFO03	4.4500 % NRUC 4.45 03/13/26	0	200	0	200 USD	98.80%	197'600.80	0.01	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	0	300	0	300 USD	91.41%	274'241.10	0.02	a)
US639057AF59	5.5160 % NWG 5.516 09/30/28	0	300	0	300 USD	100.03%	300'102.00	0.02	a)
US639057AH16	6.0160 % NWG 6.016 03/02/34	0	250	0	250 USD	101.72%	254'306.00	0.02	a)
US639057AK45	5.8080 % NWG 5.808 09/13/29	0	300	0	300 USD	100.63%	301'902.90	0.02	a)
US63946BAJ98	4.4500 % CMCSA 4.45 01/15/43	340	0	0	340 USD	87.21%	296'520.12	0.02	a)
US64110DAK00	2.7000 % NTAP 2.7 06/22/30	0	200	0	200 USD	85.59%	171'179.40	0.01	a)
US64110DAL82	1.8750 % NTAP 1 7/8 06/22/25	500	0	0	500 USD	95.22%	476'113.50	0.03	a)
US64110LAL09	5.8750 % NFLX 5 7/8 02/15/25	0	250	0	250 USD	100.25%	250'625.00	0.02	a)
US64110LAN64	4.3750 % NFLX 4 3/8 11/15/26	0	300	0	300 USD	98.38%	295'125.00	0.02	a)
US64110LAS51	4.8750 % NFLX 4 7/8 04/15/28	0	500	0	500 USD	99.75%	498'750.00	0.03	a)
US64110LAT35	5.8750 % NFLX 5 7/8 11/15/28	0	600	0	600 USD	103.60%	621'600.00	0.04	a)
US64110LAX47	6.3750 % NFLX 6 3/8 05/15/29	0	250	0	250 USD	106.25%	265'625.00	0.02	a)
US651229AW64	4.7000 % NWL 4.2 04/01/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US651229BB19	4.8750 % NWL 4 7/8 06/01/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US651229BD74	6.6250 % NWL 6 5/8 09/15/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US651639AM86	6.2500 % NEM 6 1/4 10/01/39	260	0	0	260 USD	105.54%	274'400.62	0.02	a)
US651639AP18	4.8750 % NEM 4 7/8 03/15/42	290	0	0	290 USD	92.15%	267'226.88	0.02	a)
US651639AW68	5.8750 % NEM 5 7/8 04/01/35	230	0	0	230 USD	103.05%	237'016.38	0.01	a)
US651639AY25	2.2500 % NEM 2 1/4 10/01/30	500	0	0	500 USD	83.43%	417'152.00	0.03	a)
US651639AZ99	2.6000 % NEM 2.6 07/15/32	200	0	0	200 USD	82.38%	164'759.40	0.01	a)
US65334HAA05	7.8750 % CNOOC 7 7/8 03/15/32	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65334HAE27	5.8750 % CNOOC 5 7/8 03/10/35	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65334HAG74	6.4000 % CNOOC 6.4 05/15/37	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65334HAJ14	7.5000 % CNOOC 7 1/2 07/30/39	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65339KBK51	5.6500 % NEE 5.65 05/01/2079	500	0	0	500 USD	96.00%	480'000.00	0.03	a)
US65339KBPP49	6.0510 % NEE 6.051 03/01/25	0	300	0	300 USD	100.43%	301'295.70	0.02	a)
US65339KBR05	2.2500 % NEE 2 1/4 06/01/30	500	0	0	500 USD	83.97%	419'829.50	0.03	a)
US65339KBW99	1.9000 % NEE 1.9 06/15/28	0	1'000	0	1'000 USD	87.51%	875'067.00	0.05	a)
US65339KBY55	1.8750 % NEE 1 7/8 01/15/27	0	400	0	400 USD	91.20%	364'810.00	0.02	a)
US65339KBZ21	2.4400 % NEE 2.44 01/15/32	0	800	0	800 USD	81.34%	650'712.00	0.04	a)
US65339KCF57	4.2000 % NEE 4.2 06/20/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US65339KCH14	4.6250 % NEE 4 5/8 07/15/27	500	0	0	500 USD	98.34%	491'715.50	0.03	a)
US65339KCI79	5.0000 % NEE 5 07/15/32	300	0	0	300 USD	97.81%	293'425.20	0.02	a)
US65339KCM09	4.9000 % NEE 4.9 02/28/28	0	1'000	0	1'000 USD	99.24%	992'398.00	0.06	a)
US65339KCN81	5.0000 % NEE 5 02/28/30	0	600	0	600 USD	99.10%	594'604.80	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 USD	in % 7)	Kat.
US65339KCP30	5.0500 % NEE 5.05 02/28/33	0	400	0	400 USD	97.59%	390'351.60	0.02	a)
US65339KCQ13	5.2500 % NEE 5 1/4 02/28/53	0	500	0	500 USD	93.59%	467'969.00	0.03	a)
US654106AD51	3.6250 % NKE 3 5/8 05/01/43	350	0	0	350 USD	81.46%	285'121.20	0.02	a)
US654106AE35	3.8750 % NKE 3 7/8 11/01/45	300	0	0	300 USD	82.94%	248'815.50	0.02	a)
US654106AF00	2.3750 % NKE 2 3/8 11/01/26	700	0	0	700 USD	93.95%	657'676.60	0.04	a)
US654106AG82	3.3750 % NKE 3 3/8 11/01/46	100	0	0	100 USD	75.73%	75'730.70	0.00	a)
US654106AK94	2.8500 % NKE 2.85 03/27/30	500	0	0	500 USD	89.84%	449'191.00	0.03	a)
US654106AL77	3.2500 % NKE 3 1/4 03/27/40	300	0	0	300 USD	79.31%	237'926.70	0.01	a)
US654106AM50	3.3750 % NKE 3 3/8 03/27/50	500	0	0	500 USD	75.81%	379'054.50	0.02	a)
US65473PAK12	0.9500 % NI 0.95 08/15/25	500	0	0	500 USD	93.68%	468'404.50	0.03	a)
US65473PAL94	1.7000 % NI 1.7 02/15/31	500	0	0	500 USD	79.41%	397'073.00	0.02	a)
US65473QBE26	3.4900 % NI 3.49 05/15/27	500	0	0	500 USD	95.05%	475'229.50	0.03	a)
US65473QBF90	4.3750 % NI 4 3/8 05/15/47	550	200	0	750 USD	82.56%	619'175.25	0.04	a)
US65535HAP47	2.6480 % NOMURA 2.648 01/16/25	500	0	0	500 USD	97.44%	487'175.00	0.03	a)
US65535HAQ20	3.1030 % NOMURA 3.103 01/16/30	500	0	0	500 USD	87.86%	439'324.50	0.03	a)
US65535HAR03	1.8510 % NOMURA 1.851 07/16/25	500	0	0	500 USD	94.77%	473'834.50	0.03	a)
US65535HAS85	2.6790 % NOMURA 2.679 07/16/30	500	0	0	500 USD	84.66%	423'282.50	0.03	a)
US65535HAW97	1.6530 % NOMURA 1.653 07/14/26	500	0	0	500 USD	91.51%	457'559.50	0.03	a)
US65535HAY53	2.1720 % NOMURA 2.172 07/14/28	500	0	0	500 USD	87.05%	435'237.50	0.03	a)
US65535HAZ29	2.3290 % NOMURA 2.329 01/22/27	0	200	0	200 USD	91.63%	183'263.00	0.01	a)
US65535HBA68	2.9990 % NOMURA 2.999 01/22/32	500	0	0	500 USD	83.63%	418'168.00	0.03	a)
US65535HBC25	5.6050 % NOMURA 5.605 07/06/29	200	0	0	200 USD	100.36%	200'721.20	0.01	a)
US65535HBF55	5.3860 % NOMURA 5.386 07/06/27	400	0	0	400 USD	99.45%	397'795.60	0.02	a)
US65535HBH12	5.8420 % NOMURA 5.842 01/18/28	0	200	0	200 USD	101.46%	202'921.80	0.01	a)
US65535HBK41	6.1810 % NOMURA 6.181 01/18/33	0	400	0	400 USD	104.69%	418'769.20	0.03	a)
US65535HBM07	6.0700 % NOMURA 6.07 07/12/28	0	250	0	250 USD	102.16%	255'410.00	0.02	a)
US65535HBP38	6.0870 % NOMURA 6.087 07/12/33	0	200	0	200 USD	103.98%	207'958.80	0.01	a)
US655663AB89	5.8000 % NDSN 5.8 09/15/33	0	150	0	150 USD	102.91%	154'367.70	0.01	a)
US665772CR86	2.9000 % XEL 2.9 03/01/50	1'000	0	0	1'000 USD	65.39%	653'895.00	0.04	a)
US665859AT17	3.6500 % NTRS 3.65 08/03/28	200	0	0	200 USD	95.57%	191'131.80	0.01	a)
US665859AW46	4.0000 % NTRS 4 05/10/27	500	0	0	500 USD	97.17%	485'833.00	0.03	a)
US665859AX29	6.1250 % NTRS 6 1/8 11/02/32	500	0	0	500 USD	105.15%	525'767.50	0.03	a)
US66988AAH77	3.1680 % NOVANT 3.168 11/01/51	0	150	0	150 USD	67.66%	101'497.05	0.01	a)
US66989HAG39	3.4000 % NOVNVX 3.4 05/06/24	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US66989HAH12	4.4000 % NOVNVX 4.4 05/06/44	500	0	0	500 USD	91.04%	455'195.50	0.03	a)
US66989HAJ77	3.0000 % NOVNVX 3 11/20/25	520	0	0	520 USD	96.84%	503'578.40	0.03	a)
US66989HAK41	4.0000 % NOVNVX 4 11/20/45	750	0	0	750 USD	85.00%	637'522.50	0.04	a)
US66989HAN89	3.1000 % NOVNVX 3.1 05/17/27	500	0	0	500 USD	95.10%	475'522.00	0.03	a)
US66989HAP38	1.7500 % NOVNVX 1 3/4 02/14/25	200	500	0	700 USD	96.88%	678'169.80	0.04	a)
US66989HAR93	2.2000 % NOVNVX 2.2 08/14/30	3'000	0	0	3'000 USD	85.86%	2'575'866.00	0.16	a)
US66989HAS76	2.7500 % NOVNVX 2 3/4 08/14/50	500	0	0	500 USD	66.55%	332'748.50	0.02	a)
US67021CAM91	3.2000 % ES 3.2 05/15/27	0	300	0	300 USD	95.10%	285'314.10	0.02	a)
US670346AP04	3.9500 % NUE 3.95 05/01/28	400	0	0	400 USD	96.58%	386'304.00	0.02	a)
US670346AV71	3.1250 % NUE 3 1/8 04/01/32	400	0	0	400 USD	87.21%	348'849.60	0.02	a)
US670346AW54	3.8500 % NUE 3.85 04/01/52	200	0	0	200 USD	78.33%	156'654.20	0.01	a)
US670346AX38	3.9500 % NUE 3.95 05/23/25	200	0	0	200 USD	98.44%	196'878.80	0.01	a)
US67066GAE44	3.2000 % NVDA 3.2 09/16/26	750	0	0	750 USD	96.42%	723'143.25	0.05	a)
US67066GAF19	2.8500 % NVDA 2.85 04/01/30	500	0	0	500 USD	90.04%	450'187.00	0.03	a)
US67066GAG91	3.5000 % NVDA 3 1/2 04/01/40	250	0	0	250 USD	83.75%	209'375.50	0.01	a)
US67066GAH74	3.5000 % NVDA 3 1/2 04/01/50	500	0	0	500 USD	78.46%	392'301.50	0.02	a)
US67066GAJ31	3.7000 % NVDA 3.7 04/01/60	250	0	0	250 USD	78.36%	195'911.50	0.01	a)
US67066GAL86	0.5840 % NVDA 0.584 06/14/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US67066GAM69	1.5500 % NVDA 1.55 06/15/28	250	0	0	250 USD	88.43%	221'068.75	0.01	a)
US67066GAN43	2.0000 % NVDA 2 06/15/31	250	0	0	250 USD	83.46%	208'656.75	0.01	a)
US67077MAT53	4.2000 % NTRCN 4.2 04/01/29	500	0	0	500 USD	96.16%	480'789.00	0.03	a)
US67077MAX65	3.9500 % NTRCN 3.95 05/13/50	500	0	0	500 USD	77.66%	388'281.00	0.02	a)
US67077MBA53	4.9000 % NTRCN 4.9 03/27/28	0	200	0	200 USD	98.92%	197'847.60	0.01	a)
US67077MBB37	5.8000 % NTRCN 5.8 03/27/53	0	200	0	200 USD	100.09%	200'179.20	0.01	a)
US67078AAF03	5.6500 % NVT 5.65 05/15/33	0	150	0	150 USD	99.82%	149'727.75	0.01	a)
US674599DC69	5.5500 % OXY 5.55 03/15/26	0	500	0	500 USD	100.48%	502'400.00	0.03	a)
US674599DD43	7.5000 % OXY 7 1/2 05/01/31	0	300	0	300 USD	110.38%	331'125.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US674599DF90	6.4500 % OXY 6.45 09/15/36	0	600	0	600 USD	105.25%	631'500.00	0.04	a)
US674599DJ13	6.2000 % OXY 6.2 03/15/40	0	450	0	450 USD	101.25%	455'625.00	0.03	a)
US674599DL68	6.6000 % OXY 6.6 03/15/46	0	250	0	250 USD	106.00%	265'000.00	0.02	a)
US674599EA94	8.8750 % OXY 8 7/8 07/15/30	0	400	0	400 USD	115.20%	460'800.00	0.03	a)
US674599EB77	5.8750 % OXY 5 7/8 09/01/25	0	250	0	250 USD	100.20%	250'500.00	0.02	a)
US674599ED34	6.6250 % OXY 6 5/8 09/01/30	0	500	0	500 USD	105.20%	526'000.00	0.03	a)
US674599EF81	6.1250 % OXY 6 1/8 01/01/31	0	400	0	400 USD	102.60%	410'400.00	0.03	a)
US680223AK06	3.8750 % ORI 3 7/8 08/26/26	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US681919BC93	4.2000 % OMC 4.2 06/01/30	500	0	0	500 USD	94.36%	471'819.50	0.03	a)
US681919BD76	2.6000 % OMC 2.6 08/01/31	0	230	0	230 USD	83.82%	192'780.71	0.01	a)
US681936BK50	4.7500 % OHI 4 3/4 01/15/28	400	0	0	400 USD	95.86%	383'451.60	0.02	a)
US681936BM17	3.3750 % OHI 3 3/8 02/01/31	500	0	0	500 USD	84.03%	420'140.00	0.03	a)
US68217FAA03	3.6000 % OMC 3.6 04/15/26	500	0	0	500 USD	96.89%	484'447.50	0.03	a)
US68233JBR41	3.1000 % ONCRX 3.1 09/15/49	500	0	0	500 USD	68.84%	344'210.50	0.02	a)
US68235PAF53	4.6580 % OGS 4.658 02/01/44	0	200	0	200 USD	89.11%	178'215.80	0.01	a)
US682680AS26	4.0000 % OKE 4 07/13/27	200	0	0	200 USD	96.32%	192'642.20	0.01	a)
US682680AT09	4.9500 % OKE 4.95 07/13/47	1'000	0	0	1'000 USD	86.64%	866'374.00	0.05	a)
US682680AU71	4.5500 % OKE 4.55 07/15/28	500	0	0	500 USD	97.56%	487'806.00	0.03	a)
US682680AW38	4.3500 % OKE 4.35 03/15/29	0	200	0	200 USD	96.42%	192'840.40	0.01	a)
US682680BB81	3.1000 % OKE 3.1 03/15/30	500	0	0	500 USD	88.54%	442'708.50	0.03	a)
US682680BE21	6.3500 % OKE 6.35 01/15/31	300	0	0	300 USD	104.83%	314'490.60	0.02	a)
US682680BG78	6.1000 % OKE 6.1 11/15/32	0	200	0	200 USD	103.50%	207'007.20	0.01	a)
US682680BH51	5.5500 % OKE 5.55 11/01/26	0	360	0	360 USD	100.63%	362'283.48	0.02	a)
US682680BJ18	5.6500 % OKE 5.65 11/01/28	0	220	0	220 USD	101.76%	223'873.10	0.01	a)
US682680BL63	6.0500 % OKE 6.05 09/01/33	0	430	0	430 USD	103.07%	443'199.28	0.03	a)
US682680BN20	6.6250 % OKE 6 5/8 09/01/53	0	510	0	510 USD	108.02%	550'904.04	0.03	a)
US682680BS17	3.2500 % OKE 3 1/4 06/01/30	0	250	0	250 USD	89.35%	223'373.92	0.01	a)
US682680BV46	5.1500 % OKE 5.15 10/15/43	0	500	0	500 USD	90.32%	451'587.28	0.03	a)
US682680BX02	4.2500 % OKE 4 1/4 09/15/46	0	200	0	200 USD	77.92%	155'834.04	0.01	a)
US682680BZ59	4.8500 % OKE 4.85 02/01/49	0	250	0	250 USD	85.33%	213'326.86	0.01	a)
US68268NAG88	6.1250 % OKE 6 1/8 02/01/41	300	0	0	300 USD	101.61%	304'829.10	0.02	a)
US68268NAP87	4.9000 % OKE 4.9 03/15/25	150	0	0	150 USD	99.24%	148'863.90	0.01	a)
US685218AB52	5.5000 % ORAFP 5 1/2 02/06/44	400	500	0	900 USD	100.60%	905'400.00	0.06	a)
US686330AJ06	3.7000 % ORIX 3 07/18/27	500	0	0	500 USD	95.66%	478'294.50	0.03	a)
US686330AK78	3.2500 % ORIX 3 1/4 12/04/24	300	0	0	300 USD	98.14%	294'426.00	0.02	a)
US686330AR22	5.2000 % ORIX 5.2 09/13/32	300	0	0	300 USD	100.79%	302'373.00	0.02	a)
US68902VAH06	2.0560 % OTIS 2.056 04/05/25	500	0	0	500 USD	96.12%	480'617.00	0.03	a)
US68902VAJ61	2.2930 % OTIS 2.293 04/05/27	0	150	0	150 USD	92.24%	138'356.40	0.01	a)
US68902VAK35	2.5650 % OTIS 2.565 02/15/30	500	0	0	500 USD	87.33%	436'660.00	0.03	a)
US68902VAL18	3.1120 % OTIS 3.112 02/15/40	0	200	0	200 USD	76.16%	152'321.20	0.01	a)
US68902VAM90	3.3620 % OTIS 3.362 02/15/50	0	300	0	300 USD	71.77%	215'295.00	0.01	a)
US68902VAP22	5.2500 % OTIS 5 1/4 08/16/28	0	219	0	219 USD	100.68%	220'483.94	0.01	a)
US69047QAB86	5.6500 % OVV 5.65 05/15/28	0	200	0	200 USD	100.79%	201'577.80	0.01	a)
US69047QAC69	6.2500 % OVV 6 1/4 07/15/33	0	170	0	170 USD	102.63%	174'476.10	0.01	a)
US690742AG60	4.3000 % OC 4.3 07/15/47	200	0	0	200 USD	81.52%	163'042.60	0.01	a)
US69120VAR24	7.9500 % OCINCC 7.95 06/13/28	0	250	0	250 USD	103.30%	258'249.00	0.02	a)
US69120VAU52	7.7500 % OCINCC 7 3/4 01/15/29	0	200	0	200 USD	102.34%	204'682.40	0.01	a)
US69121KAC80	3.7500 % OBDC 3 3/4 07/22/25	400	0	0	400 USD	96.36%	385'453.60	0.02	a)
US69121KAE47	3.4000 % OBDC 3.4 07/15/26	500	0	0	500 USD	92.99%	464'972.50	0.03	a)
US69121KAG94	2.8750 % OBDC 2 7/8 06/11/28	200	0	0	200 USD	87.49%	174'976.00	0.01	a)
US693304BF31	4.9000 % EXC 4.9 06/15/33	0	150	0	150 USD	99.04%	148'559.55	0.01	a)
US693475AP09	3.9000 % PNC 3.9 04/29/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US693475AT21	3.1500 % PNC 3.15 05/19/27	500	0	0	500 USD	94.20%	471'011.50	0.03	a)
US693475AW59	3.4500 % PNC 3.45 04/23/29	250	0	0	250 USD	92.46%	231'149.50	0.01	a)
US693475AX33	2.6000 % PNC 2.6 07/23/26	0	250	0	250 USD	94.03%	235'079.25	0.01	a)
US693475AY16	2.2000 % PNC 2.2 11/01/24	400	0	0	400 USD	97.81%	391'256.00	0.02	a)
US693475AZ80	2.5500 % PNC 2.55 01/22/30	400	0	0	400 USD	85.90%	343'613.20	0.02	a)
US693475BA21	2.3070 % PNC 2.307 04/23/32	400	0	0	400 USD	80.97%	323'892.00	0.02	a)
US693475BE43	4.6260 % PNC 4.626 06/06/33	200	0	0	200 USD	92.69%	185'388.40	0.01	a)
US693475BJ30	6.0370 % PNC 6.037 10/28/33	500	0	0	500 USD	102.40%	512'008.50	0.03	a)
US693475BK03	5.3540 % PNC 5.354 12/02/28	700	0	0	700 USD	100.05%	700'339.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US693475BL85	4.7580 % PNC 4.758 01/26/27	0	500	0	500 USD	98.69%	493'445.00	0.03	a)
US693475BM68	5.0680 % PNC 5.068 01/24/34	300	150	0	450 USD	96.08%	432'380.25	0.03	a)
US693475BQ72	5.8120 % PNC 5.812 06/12/26	0	400	0	400 USD	100.15%	400'608.40	0.03	a)
US693475BR55	5.5820 % PNC 5.582 06/12/29	0	650	0	650 USD	100.71%	654'613.70	0.04	a)
US693475BS39	5.9390 % PNC 5.939 08/18/34	0	250	0	250 USD	101.41%	253'527.25	0.02	a)
US693475BT12	6.6150 % PNC 6.615 10/20/27	0	300	0	300 USD	102.80%	308'409.90	0.02	a)
US693475BU84	6.8750 % PNC 6 7/8 10/20/34	0	900	0	900 USD	108.78%	979'049.70	0.06	a)
US693475BV67	5.3000 % PNC 5.3 01/21/28	0	300	0	300 USD	99.92%	299'758.80	0.02	a)
US693475BW41	5.6760 % PNC 5.676 01/22/35	0	450	0	450 USD	100.22%	451'011.60	0.03	a)
US69349LAQ14	4.2000 % PNC 4.2 11/01/25 BKNT	500	0	0	500 USD	97.63%	488'154.50	0.03	a)
US693506BP19	3.7500 % PPG 3 3/4 03/15/28	500	0	0	500 USD	95.52%	477'624.50	0.03	a)
US693506BU04	1.2000 % PPG 1.2 03/15/26	0	200	0	200 USD	92.30%	184'594.60	0.01	a)
US69351UBB89	5.2500 % PPL 5 1/4 05/15/53	0	400	0	400 USD	97.35%	389'401.20	0.02	a)
US69352PAL76	3.1000 % PPL 3.1 05/15/26	400	0	0	400 USD	95.38%	381'527.60	0.02	a)
US69353REF10	3.3000 % PNC 3.3 10/30/24 BKNT	500	0	0	500 USD	98.57%	492'860.00	0.03	a)
US69353REK05	2.9500 % PNC 2.95 02/23/25 BKNT	250	0	0	250 USD	97.62%	244'049.25	0.02	a)
US694308HP52	2.9500 % PCG 2.95 03/01/26	0	200	0	200 USD	94.70%	189'393.20	0.01	a)
US694308HW04	3.3000 % PCG 3.3 12/01/27	0	200	0	200 USD	92.44%	184'883.60	0.01	a)
US694308HY69	3.9500 % PCG 3.95 12/01/47	1'000	0	0	1'000 USD	72.54%	725'409.00	0.05	a)
US694308JF52	2.1000 % PCG 2.1 08/01/27	250	0	0	250 USD	89.58%	223'959.75	0.01	a)
US694308JG36	2.5000 % PCG 2 1/2 02/01/31	1'000	0	0	1'000 USD	82.00%	819'970.00	0.05	a)
US694308JH19	3.3000 % PCG 3.3 08/01/40	1'000	200	0	1'200 USD	72.23%	866'773.20	0.05	a)
US694308JJ74	3.5000 % PCG 3 1/2 08/01/50	500	0	0	500 USD	67.17%	335'860.50	0.02	a)
US694308JK48	3.7500 % PCG 3 3/4 07/01/28	0	200	0	200 USD	92.93%	185'851.60	0.01	a)
US694308JL21	3.4500 % PCG 3.45 07/01/25	250	0	0	250 USD	96.84%	242'103.00	0.02	a)
US694308JM04	4.5500 % PCG 4.55 07/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	94.07%	940'688.00	0.06	a)
US694308JN86	4.9500 % PCG 4.95 07/01/50	1'000	0	0	1'000 USD	85.23%	852'311.00	0.05	a)
US694308JT56	3.2500 % PCG 3 1/4 06/01/31	250	100	0	350 USD	85.65%	299'787.25	0.02	a)
US694308JW85	3.0000 % PCG 3 06/15/28	0	400	0	400 USD	90.48%	361'903.60	0.02	a)
US694308KD85	5.2500 % PCG 5 1/4 03/01/52	250	0	0	250 USD	89.01%	222'536.50	0.01	a)
US694308KH99	6.7500 % PCG 6 3/4 01/15/53	0	400	0	400 USD	107.39%	429'576.80	0.03	a)
US694308KJ55	6.1500 % PCG 6.15 01/15/33	0	250	0	250 USD	102.30%	255'749.25	0.02	a)
US694308KK29	6.7000 % PCG 6.7 04/01/53	0	200	0	200 USD	107.50%	214'996.00	0.01	a)
US694308KL02	6.1000 % PCG 6.1 01/15/29	0	200	0	200 USD	102.36%	204'722.40	0.01	a)
US694308KM84	6.4000 % PCG 6.4 06/15/33	0	500	0	500 USD	103.74%	518'707.50	0.03	a)
US694308KP16	6.9500 % PCG 6.95 03/15/34	0	400	0	400 USD	107.93%	431'702.00	0.03	a)
US695156AT63	3.4000 % PKG 3.4 12/15/27	200	0	0	200 USD	94.38%	188'757.80	0.01	a)
US695156AU37	3.0000 % PKG 3 12/15/29	500	0	0	500 USD	89.55%	447'767.00	0.03	a)
US695156AW92	3.0500 % PKG 3.05 10/01/51	0	150	0	150 USD	66.91%	100'370.25	0.01	a)
US701094AL88	4.1000 % PH 4.1 03/01/47	0	200	0	200 USD	81.66%	163'313.20	0.01	a)
US701094AN45	3.2500 % PH 3 1/4 06/14/29	500	0	0	500 USD	91.79%	458'959.50	0.03	a)
US701094AP92	4.0000 % PH 4 06/14/49	0	200	0	200 USD	81.09%	162'189.20	0.01	a)
US701094AQ75	3.6500 % PH 3.65 06/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US701094AR58	4.2500 % PH 4 1/4 09/15/27	500	0	0	500 USD	97.69%	488'438.00	0.03	a)
US701094AS32	4.5000 % PH 4 1/2 09/15/29	200	100	0	300 USD	97.79%	293'358.30	0.02	a)
US701094HAL96	3.3000 % PH 3.3 11/21/24 MTN	200	0	0	200 USD	98.36%	196'720.00	0.01	a)
US701094HAM79	4.2000 % PH 4.2 11/21/34 MTN	0	200	0	200 USD	92.02%	184'047.40	0.01	a)
US701094HAN52	4.4500 % PH 4.45 11/21/44 MTN	400	0	0	400 USD	87.47%	349'888.80	0.02	a)
US70213BAB71	3.7000 % PRE 3.7 07/02/29	200	0	0	200 USD	93.76%	187'522.40	0.01	a)
US70450YAC75	2.4000 % PYPL 2.4 10/01/24	500	0	0	500 USD	98.24%	491'215.00	0.03	a)
US70450YAD58	2.6500 % PYPL 2.65 10/01/26	500	0	0	500 USD	94.34%	471'687.50	0.03	a)
US70450YAG89	1.6500 % PYPL 1.65 06/01/25	500	0	0	500 USD	95.68%	478'375.50	0.03	a)
US70450YAH62	2.3000 % PYPL 2.3 06/01/30	500	0	0	500 USD	85.12%	425'624.50	0.03	a)
US70450YAJ29	3.2500 % PYPL 3 1/4 06/01/50	500	0	0	500 USD	69.99%	349'938.50	0.02	a)
US70450YAL74	4.4000 % PYPL 4.4 06/01/32	200	0	0	200 USD	95.60%	191'204.00	0.01	a)
US70450YAM57	5.0500 % PYPL 5.05 06/01/52	350	0	0	350 USD	93.79%	328'252.40	0.02	a)
US713448CT37	2.7500 % PEP 2 3/4 04/30/25	250	0	0	250 USD	97.32%	243'304.50	0.02	a)
US713448CY22	3.5000 % PEP 3 1/2 07/17/25	500	0	0	500 USD	97.94%	489'697.00	0.03	a)
US713448DF24	2.8500 % PEP 2.85 02/24/26	500	0	0	500 USD	96.17%	480'871.50	0.03	a)
US713448DN57	2.3750 % PEP 2 3/8 10/06/26	750	0	0	750 USD	94.21%	706'584.00	0.04	a)
US713448DP06	3.4500 % PEP 3.45 10/06/46	800	0	0	800 USD	77.42%	619'344.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US713448DY13	3.0000 % PEP 3 10/15/27	500	0	0	500 USD	94.34%	471'706.00	0.03	a)
US713448EP96	2.8750 % PEP 2 7/8 10/15/49	0	200	0	200 USD	69.05%	138'106.00	0.01	a)
US713448EQ79	2.2500 % PEP 2 1/4 03/19/25	500	0	0	500 USD	97.04%	485'191.50	0.03	a)
US713448EU81	3.6250 % PEP 3 5/8 03/19/50	500	0	0	500 USD	78.56%	392'815.00	0.02	a)
US713448EZ78	1.6250 % PEP 1 5/8 05/01/30	500	0	0	500 USD	83.10%	415'496.50	0.03	a)
US713448FA19	1.4000 % PEP 1.4 02/25/31	1'000	0	0	1'000 USD	79.90%	799'023.00	0.05	a)
US713448FF06	2.6250 % PEP 2 5/8 10/21/41	0	200	0	200 USD	71.61%	143'228.20	0.01	a)
US713448FG88	2.7500 % PEP 2 3/4 10/21/51	0	300	0	300 USD	65.79%	197'360.10	0.01	a)
US713448FL73	3.6000 % PEP 3.6 02/18/28	400	0	0	400 USD	96.12%	384'481.20	0.02	a)
US713448FM56	3.9000 % PEP 3.9 07/18/32	500	0	0	500 USD	93.82%	469'111.50	0.03	a)
US713448FR44	4.4500 % PEP 4.45 05/15/28	0	200	0	200 USD	99.79%	199'573.20	0.01	a)
US713448FS27	4.4500 % PEP 4.45 02/15/33	0	200	0	200 USD	98.89%	197'779.60	0.01	a)
US713448FT00	4.6500 % PEP 4.65 02/15/53	0	450	0	450 USD	93.30%	419'860.35	0.03	a)
US714046AG46	3.3000 % RVTY 3.3 09/15/29	0	200	0	200 USD	90.15%	180'303.00	0.01	a)
US714046AM14	1.9000 % RVTY 1.9 09/15/28	500	0	0	500 USD	86.51%	432'566.50	0.03	a)
US714046AN96	2.2500 % RVTY 2 1/4 09/15/31	200	0	0	200 USD	80.91%	161'828.60	0.01	a)
US71644EAJ10	6.8000 % SUCN 6.8 05/15/38	500	0	0	500 USD	106.55%	532'735.00	0.03	a)
US716973AB84	4.4500 % PFE 4.45 05/19/26	0	500	0	500 USD	98.77%	493'870.00	0.03	a)
US716973AC67	4.4500 % PFE 4.45 05/19/28	0	1'000	0	1'000 USD	98.17%	981'651.00	0.06	a)
US716973AD41	4.6500 % PFE 4.65 05/19/30	0	700	0	700 USD	98.23%	687'588.30	0.04	a)
US716973AE24	4.7500 % PFE 4 3/4 05/19/33	0	1'650	0	1'650 USD	97.06%	1'601'460.30	0.10	a)
US716973AF98	5.1100 % PFE 5.11 05/19/43	0	1'000	0	1'000 USD	96.09%	960'907.00	0.06	a)
US716973AG71	5.3000 % PFE 5.3 05/19/53	0	1'950	0	1'950 USD	97.94%	1'909'906.05	0.12	a)
US716973AH54	5.3400 % PFE 5.34 05/19/63	0	1'100	0	1'100 USD	96.48%	1'061'320.70	0.07	a)
US717081CY74	7.2000 % PFE 7.2 03/15/39	520	0	0	520 USD	118.89%	618'251.40	0.04	a)
US717081DK61	4.4000 % PFE 4.4 05/15/44	520	0	0	520 USD	89.99%	467'937.60	0.03	a)
US717081DM28	3.4000 % PFE 3.4 05/15/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US717081DV27	2.7500 % PFE 2 3/4 06/03/26	850	0	0	850 USD	95.57%	812'342.45	0.05	a)
US717081EA70	3.0000 % PFE 3 12/15/26	650	0	0	650 USD	95.34%	619'707.40	0.04	a)
US717081ED10	4.1250 % PFE 4 1/8 12/15/46	450	0	0	450 USD	83.50%	375'770.25	0.02	a)
US717081EJ89	4.1000 % PFE 4.1 09/15/38	1'000	0	0	1'000 USD	88.21%	882'132.00	0.06	a)
US717081EK52	4.2000 % PFE 4.2 09/15/48	500	0	0	500 USD	86.02%	430'120.50	0.03	a)
US717081ET61	3.4500 % PFE 3.45 03/15/29	500	0	0	500 USD	94.13%	470'636.50	0.03	a)
US717081EW90	2.6250 % PFE 2 5/8 04/01/30	500	0	0	500 USD	88.27%	441'370.50	0.03	a)
US717081EX73	0.8000 % PFE 0.8 05/28/25	2'000	0	0	2'000 USD	94.89%	1'897'864.00	0.12	a)
US717081EZ22	2.5500 % PFE 2.55 05/28/40	500	0	0	500 USD	70.19%	350'973.00	0.02	a)
US717081FA61	2.7000 % PFE 2.7 05/28/50	0	200	0	200 USD	65.64%	131'280.20	0.01	a)
US718546AH74	5.8750 % PSX 5 7/8 05/01/42	650	0	0	650 USD	103.17%	670'620.60	0.04	a)
US718546AK04	4.6500 % PSX 4.65 11/15/34	700	0	0	700 USD	94.01%	658'080.50	0.04	a)
US718546AL86	4.8750 % PSX 4 7/8 11/15/44	400	0	0	400 USD	91.41%	365'625.20	0.02	a)
US718546AV68	3.8500 % PSX 3.85 04/09/25	500	0	0	500 USD	98.22%	491'124.00	0.03	a)
US718546AW42	2.1500 % PSX 2.15 12/15/30	250	0	0	250 USD	82.93%	207'320.00	0.01	a)
US718546AZ72	1.3000 % PSX 1.3 02/15/26	450	0	0	450 USD	92.54%	416'450.70	0.03	a)
US718546BA13	3.3000 % PSX 3.3 03/15/52	750	0	0	750 USD	68.33%	512'481.00	0.03	a)
US72147KAH14	3.5000 % PPC 3 1/2 03/01/32	0	250	0	250 USD	83.50%	208'750.00	0.01	a)
US72147KAJ79	4.2500 % PPC 4 1/4 04/15/31	0	300	0	300 USD	89.13%	267'375.00	0.02	a)
US72147KAK43	6.2500 % PPC 6 1/4 07/01/33	0	290	0	290 USD	100.88%	292'537.50	0.02	a)
US72147KAL26	6.8750 % PPC 6 7/8 05/15/34	0	150	0	150 USD	105.25%	157'875.00	0.01	a)
US723787AQ06	1.9000 % PXD 1.9 08/15/30	300	0	0	300 USD	83.13%	249'391.20	0.02	a)
US723787AR88	2.1500 % PXD 2.15 01/15/31	250	0	0	250 USD	83.63%	209'066.75	0.01	a)
US723787AT45	1.1250 % PXD 1 1/8 01/15/26	250	0	0	250 USD	92.96%	232'411.75	0.01	a)
US72650RAR30	6.6500 % PAA 6.65 01/15/37	0	200	0	200 USD	105.00%	210'007.40	0.01	a)
US72650RBE18	4.7000 % PAA 4.7 06/15/44	250	0	0	250 USD	82.80%	206'991.25	0.01	a)
US72650RBF82	3.6000 % PAA 3.6 11/01/24	250	0	0	250 USD	98.70%	246'747.50	0.02	a)
US72650RBH49	4.9000 % PAA 4.9 02/15/45	500	0	0	500 USD	84.26%	421'317.50	0.03	a)
US72650RBJ05	4.6500 % PAA 4.65 10/15/25	370	0	0	370 USD	98.70%	365'177.79	0.02	a)
US72650RBL50	4.5000 % PAA 4 1/2 12/15/26	500	0	0	500 USD	98.15%	490'771.00	0.03	a)
US72650RBN17	3.8000 % PAA 3.8 09/15/30	250	0	0	250 USD	91.15%	227'877.00	0.01	a)
US731068AA07	6.9500 % PII 6.95 03/15/29	0	200	0	200 USD	105.20%	210'391.80	0.01	a)
US74005PBT03	1.1000 % LIN 1.1 08/10/30	0	300	0	300 USD	80.06%	240'180.30	0.01	a)
US740816AN32	3.3000 % HARVRD 3.3 07/15/56	400	0	0	400 USD	73.50%	294'007.60	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 USD	in % 7)	Kat.
US740816AP89	2.5170 % HARVRD 2.517 10/15/50	200	0	0	200 USD	65.14%	130'275.60	0.01	a)
US740816AQ62	3.7450 % HARVRD 3.745 11/15/52	0	150	0	150 USD	82.59%	123'882.90	0.01	a)
US741503AW60	3.6500 % BKNG 3.65 03/15/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US741503BC97	3.5500 % BKNG 3.55 03/15/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74251VAA08	6.0500 % PFG 6.05 10/15/36	0	200	0	200 USD	104.73%	209'450.00	0.01	a)
US74251VAS16	2.1250 % PFG 2 1/8 06/15/30	500	0	0	500 USD	83.65%	418'267.50	0.03	a)
US74256MEQ69	1.2500 % PFG 1 1/4 08/16/26 REGS	500	0	0	500 USD	90.50%	452'485.50	0.03	a)
US742718EP07	2.7000 % PG 2.7 02/02/26	200	0	0	200 USD	96.19%	192'379.20	0.01	a)
US742718ER62	2.4500 % PG 2.45 11/03/26	200	0	0	200 USD	94.51%	189'021.80	0.01	a)
US742718EV74	2.8500 % PG 2.85 08/11/27	500	0	0	500 USD	94.43%	472'170.50	0.03	a)
US742718FH71	3.0000 % PG 3 03/25/30	1'000	0	0	1'000 USD	91.43%	914'326.00	0.06	a)
US742718FJ38	3.5500 % PG 3.55 03/25/40	1'000	0	0	1'000 USD	85.53%	855'278.00	0.05	a)
US742718FL83	0.5500 % PG 0.55 10/29/25	0	250	0	250 USD	93.21%	233'020.00	0.01	a)
US742718FV65	1.9000 % PG 1.9 02/01/27	0	250	0	250 USD	92.84%	232'101.25	0.01	a)
US742718GA10	4.0500 % PG 4.05 01/26/33	0	250	0	250 USD	96.18%	240'454.25	0.02	a)
US743263AE50	7.7500 % DUK 7 3/4 03/01/31	500	0	0	500 USD	112.74%	563'697.50	0.04	a)
US743315AR46	2.4500 % PGR 2.45 01/15/27	1'000	940	1'940	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US743315AZ61	3.0000 % PGR 3 03/15/32	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US743315BA02	3.7000 % PGR 3.7 03/15/52	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74340XBN03	2.1250 % PLD 2 1/8 04/15/27	0	150	0	150 USD	91.81%	137'713.35	0.01	a)
US74340XBQ34	2.1250 % PLD 2 1/8 10/15/50	400	0	0	400 USD	54.55%	218'203.20	0.01	a)
US74340XBR17	1.2500 % PLD 1 1/4 10/15/30	500	0	0	500 USD	79.42%	397'114.50	0.02	a)
US74340XBT72	4.6250 % PLD 4 5/8 01/15/33	0	250	0	250 USD	96.41%	241'030.75	0.02	a)
US74340XCF69	5.2500 % PLD 5 1/4 06/15/53	0	250	0	250 USD	96.98%	242'448.00	0.02	a)
US74340XCG43	4.8750 % PLD 4 7/8 06/15/28	0	210	0	210 USD	99.91%	209'802.81	0.01	a)
US74340XCH26	5.1250 % PLD 5 1/8 01/15/34	0	350	0	350 USD	98.85%	345'979.90	0.02	a)
US74340XCJ81	5.0000 % PLD 5 03/15/34	0	250	0	250 USD	98.24%	245'589.00	0.02	a)
US743820AA01	2.5320 % PSJHOG 2.532 10/01/29 19A	200	0	0	200 USD	87.04%	174'078.60	0.01	a)
US743820AB83	2.7000 % PSJHOG 2.7 10/01/51 21A	0	120	0	120 USD	59.97%	71'959.68	0.00	a)
US743820AC66	5.4030 % PSJHOG 5.403 10/01/33	0	150	0	150 USD	99.30%	148'950.45	0.01	a)
US744320BA94	3.9350 % PRU 3.935 12/07/49	500	0	0	500 USD	79.17%	395'870.50	0.02	a)
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	1'500	0	0	1'500 USD	87.28%	1'309'135.50	0.08	a)
US744320BJ04	5.1250 % PRU 5 1/8 03/01/52	500	0	0	500 USD	93.65%	468'227.50	0.03	a)
US74432QAQ82	5.7000 % PRU 5.7 12/14/36 MTN	260	200	0	460 USD	102.99%	473'760.90	0.03	a)
US74432QCA13	4.6000 % PRU 4.6 05/15/44 MTN	500	0	0	500 USD	88.91%	444'568.00	0.03	a)
US74432QCF00	3.7000 % PRU 3.7 03/13/51 MTN	0	500	0	500 USD	76.00%	380'020.00	0.02	a)
US74432QCH65	1.5000 % PRU 1 1/2 03/10/26 MTN	500	0	0	500 USD	93.16%	465'805.50	0.03	a)
US74432QCJ22	3.0000 % PRU 3 03/10/40 MTN	0	200	0	200 USD	74.48%	148'968.60	0.01	a)
US744330AA93	3.1250 % PRUFIN 3 1/8 04/14/30	0	500	0	500 USD	88.88%	444'380.00	0.03	a)
US74435KAA34	3.1250 % PRUFIN 3 1/8 04/14/30	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744448CG45	3.6000 % XEL 3.6 09/15/42	650	0	0	650 USD	76.61%	497'934.45	0.03	a)
US74456QBQ82	3.8000 % PEG 3.8 03/01/46 MTN	500	0	0	500 USD	79.33%	396'661.00	0.02	a)
US744573AV86	5.8500 % PEG 5.85 11/15/27	400	0	0	400 USD	102.33%	409'316.00	0.03	a)
US74460DAC39	3.0940 % PSA 3.094 09/15/27	500	0	0	500 USD	94.05%	470'242.50	0.03	a)
US74460DAJ81	2.2500 % PSA 2 1/4 11/09/31	500	0	0	500 USD	82.78%	413'905.50	0.03	a)
US74460WAD92	1.8500 % PSA 1.85 05/01/28	200	0	0	200 USD	88.31%	176'616.60	0.01	a)
US74460WAE75	2.3000 % PSA 2.3 05/01/31	250	0	0	250 USD	84.04%	210'102.50	0.01	a)
US74460WAF41	5.1250 % PSA 5 1/8 01/15/29	0	140	0	140 USD	100.84%	141'179.64	0.01	a)
US74460WAG24	5.1000 % PSA 5.1 08/01/33	0	200	0	200 USD	100.08%	200'157.40	0.01	a)
US74460WAH07	5.3500 % PSA 5.35 08/01/53	0	370	0	370 USD	100.31%	371'157.36	0.02	a)
US74736KAH41	4.3750 % QRVO 4 3/8 10/15/29	300	0	0	300 USD	93.00%	279'000.00	0.02	a)
US747525AJ27	4.6500 % QCOM 4.65 05/20/35	500	0	0	500 USD	98.06%	490'280.50	0.03	a)
US747525AK99	4.8000 % QCOM 4.8 05/20/45	500	0	0	500 USD	93.91%	469'532.00	0.03	a)
US747525AU71	3.2500 % QCOM 3 1/4 05/20/27	500	0	0	500 USD	95.64%	478'183.00	0.03	a)
US747525AV54	4.3000 % QCOM 4.3 05/20/47	500	0	0	500 USD	86.91%	434'565.00	0.03	a)
US747525BK80	2.1500 % QCOM 2.15 05/20/30	500	0	0	500 USD	85.72%	428'578.00	0.03	a)
US747525BN20	1.3000 % QCOM 1.3 05/20/28	1'052	0	0	1'052 USD	87.17%	917'010.52	0.06	a)
US747525BP77	1.6500 % QCOM 1.65 05/20/32	826	0	0	826 USD	77.97%	644'006.59	0.04	a)
US747525BR34	4.5000 % QCOM 4 1/2 05/20/52	200	0	0	200 USD	88.82%	177'630.40	0.01	a)
US747525BT99	6.0000 % QCOM 6 05/20/53	500	0	0	500 USD	110.00%	549'978.50	0.03	a)
US74762EAF97	2.9000 % PWR 2.9 10/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	86.55%	865'480.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US74762EAH53	2.3500 % PWR 2.35 01/15/32	500	0	0	500 USD	79.77%	398'826.00	0.02	a)
US74834LAX82	3.5000 % DGX 3 1/2 03/30/25	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LAZ31	3.4500 % DGX 3.45 06/01/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74834LBC37	2.8000 % DGX 2.8 06/30/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US74949LAC63	4.0000 % RELN 4 03/18/29	1'000	0	0	1'000 USD	95.48%	954'809.00	0.06	a)
US75524KNH31	2.2500 % CFG 2 1/4 04/28/25 BKNT	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US756109AT12	4.6500 % O 4.65 03/15/47	200	0	0	200 USD	87.59%	175'174.60	0.01	a)
US756109AU84	3.6500 % O 3.65 01/15/28	500	0	0	500 USD	94.78%	473'891.50	0.03	a)
US756109AV67	3.8750 % O 3 7/8 04/15/25	250	0	0	250 USD	98.29%	245'736.75	0.02	a)
US756109AX24	3.2500 % O 3 1/4 01/15/31	500	0	0	500 USD	88.50%	442'500.00	0.03	a)
US756109BF09	4.8750 % O 4 7/8 06/01/26	500	0	0	500 USD	99.28%	496'408.50	0.03	a)
US756109BG81	3.9500 % O 3.95 08/15/27	0	300	0	300 USD	96.31%	288'933.60	0.02	a)
US756109BK93	3.1000 % O 3.1 12/15/29	0	150	0	150 USD	90.07%	135'100.50	0.01	a)
US756109BL76	2.8500 % O 2.85 12/15/32	500	0	0	500 USD	82.32%	411'619.50	0.03	a)
US758750AC76	6.0500 % RRX 6.05 02/15/26 144A	300	0	0	300 USD	100.55%	301'663.50	0.02	a)
US758750AD59	6.0500 % RRX 6.05 04/15/28 144A	350	0	0	350 USD	100.50%	351'759.10	0.02	a)
US758750AE33	6.3000 % RRX 6.3 02/15/30	300	0	0	300 USD	101.85%	305'560.50	0.02	a)
US758750AF08	6.4000 % RRX 6.4 04/15/33 144A	350	0	0	350 USD	102.86%	360'011.05	0.02	a)
US75884RAV50	3.6000 % REG 3.6 02/01/27	300	0	0	300 USD	95.44%	286'328.70	0.02	a)
US75886FAE79	1.7500 % REGN 1 3/4 09/15/30	500	0	0	500 USD	80.86%	404'288.50	0.03	a)
US75886FAF45	2.8000 % REGN 2.8 09/15/50	750	0	0	750 USD	62.46%	468'447.75	0.03	a)
US7591EPAQ39	2.2500 % RF 2 1/4 05/18/25	500	500	500	500 USD	95.81%	479'073.00	0.03	a)
US759351AN90	3.9000 % RGA 3.9 05/15/29	500	0	0	500 USD	94.41%	472'034.50	0.03	a)
US759351AP49	3.1500 % RGA 3.15 06/15/30	500	0	0	500 USD	88.31%	441'543.00	0.03	a)
US759509AG74	2.1500 % RS 2.15 08/15/30	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US75968NAE13	5.7500 % RNR 5 3/4 06/05/33	0	200	0	200 USD	101.13%	202'268.20	0.01	a)
US760759AR19	2.9000 % RSG 2.9 07/01/26	380	0	0	380 USD	95.34%	362'302.26	0.02	a)
US760759AT74	3.9500 % RSG 3.95 05/15/28	300	0	0	300 USD	96.05%	288'135.60	0.02	a)
US760759AU48	2.5000 % RSG 2 1/2 08/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US760759BA74	2.3750 % RSG 2 3/8 03/15/33	300	0	0	300 USD	80.09%	240'255.00	0.02	a)
US760759BB57	4.8750 % RSG 4 7/8 04/01/29	0	300	0	300 USD	99.68%	299'025.00	0.02	a)
US760759BC31	5.0000 % RSG 5 04/01/34	0	300	0	300 USD	98.39%	295'158.00	0.02	a)
US760759BH28	5.0000 % RSG 5 12/15/33	0	300	0	300 USD	98.09%	294'255.60	0.02	a)
US767201AD89	7.1250 % RIOLN 7 1/8 07/15/28	600	0	0	600 USD	108.80%	652'810.80	0.04	a)
US767201AL06	5.2000 % RIOLN 5.2 11/02/40	100	0	0	100 USD	98.51%	98'508.90	0.01	a)
US76720AAD81	4.7500 % RIOLN 4 3/4 03/22/42	500	0	0	500 USD	92.98%	464'922.50	0.03	a)
US76720AAG13	4.1250 % RIOLN 4 1/8 08/21/42	400	0	0	400 USD	85.62%	342'468.40	0.02	a)
US76720AAP12	5.1250 % RIOLN 5 1/8 03/09/53	0	300	0	300 USD	95.65%	286'963.50	0.02	a)
US77310VAA26	2.4920 % ROCKFD 2.492 10/01/50 2020	0	150	0	150 USD	63.47%	95'207.10	0.01	a)
US773903AJ82	4.2000 % ROK 4.2 03/01/49	0	200	0	200 USD	84.74%	169'477.20	0.01	a)
US775109AZ48	5.4500 % RCICN 5.45 10/01/43	100	0	0	100 USD	94.92%	94'922.80	0.01	a)
US775109BB60	5.0000 % RCICN 5 03/15/44	350	0	0	350 USD	89.73%	314'060.95	0.02	a)
US775109BE00	3.6250 % RCICN 3 5/8 12/15/25	700	0	0	700 USD	96.85%	677'925.50	0.04	a)
US775109BF74	2.9000 % RCICN 2.9 11/15/26	250	0	0	250 USD	94.09%	235'234.25	0.01	a)
US775109BG57	4.3000 % RCICN 4.3 02/15/48	750	0	0	750 USD	79.90%	599'220.00	0.04	a)
US775109BN09	4.3500 % RCICN 4.35 05/01/49	0	300	0	300 USD	80.62%	241'846.50	0.02	a)
US775109BP56	3.7000 % RCICN 3.7 11/15/49	0	100	0	100 USD	72.22%	72'222.80	0.00	a)
US775109CB51	3.2000 % RCICN 3.2 03/15/27 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US775109CC35	3.8000 % RCICN 3.8 03/15/32 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US775109CD18	4.5500 % RCICN 4.55 03/15/52 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US775109CG49	3.2000 % RCICN 3.2 03/15/27	0	500	0	500 USD	94.07%	470'331.00	0.03	a)
US775109CH22	3.8000 % RCICN 3.8 03/15/32	0	500	0	500 USD	88.96%	444'812.00	0.03	a)
US775109CJ87	4.5000 % RCICN 4 1/2 03/15/42	0	500	0	500 USD	85.38%	426'903.50	0.03	a)
US775109CK50	4.5500 % RCICN 4.55 03/15/52	0	700	0	700 USD	82.42%	576'933.00	0.04	a)
US776743AD85	3.8000 % ROP 3.8 12/15/26	0	300	0	300 USD	96.44%	289'320.90	0.02	a)
US776743AF34	4.2000 % ROP 4.2 09/15/28	0	300	0	300 USD	96.53%	289'590.90	0.02	a)
US776743AG17	2.9500 % ROP 2.95 09/15/29	0	200	0	200 USD	89.38%	178'765.60	0.01	a)
US776743AJ55	2.0000 % ROP 2 06/30/30	0	150	0	150 USD	82.94%	124'405.95	0.01	a)
US776743AL02	1.7500 % ROP 1 3/4 02/15/31	0	300	0	300 USD	80.17%	240'507.60	0.02	a)
US776743AN67	1.4000 % ROP 1.4 09/15/27	0	350	0	350 USD	88.27%	308'930.30	0.02	a)
US780082AD52	4.6500 % RY 4.65 01/27/26 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	99.07%	990'710.00	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 USD	in % 7)	Kat.
US780097BA81	4.8000 % NWG 4.8 04/05/26	1'200	0	0	1'200 USD	98.72%	1'184'606.40	0.07	a)
US780097BL47	4.4450 % NWG 4.445 05/08/30	1'000	0	0	1'000 USD	94.60%	945'977.00	0.06	a)
US780097BM20	3.7540 % NWG 3.754 11/01/29	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US780097BP50	3.0730 % NWG 3.073 05/22/28	600	0	0	600 USD	92.43%	554'550.60	0.03	a)
US78009PEH01	5.0760 % NWG 5.076 01/27/30	600	0	0	600 USD	97.85%	587'124.60	0.04	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78015K7C20	2.2500 % RY 2 1/4 11/01/24 GMTN	500	0	0	500 USD	97.87%	489'355.00	0.03	a)
US78015K7H17	1.1500 % RY 1.15 06/10/25 MTN	250	0	0	250 USD	95.00%	237'497.50	0.01	a)
US78015K7L29	0.4250 % RY 0.425 01/19/24 GMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016EYH43	2.3000 % RY 2.3 11/03/31 GMTN	500	0	0	500 USD	81.90%	409'486.00	0.03	a)
US78016EYM38	1.6000 % RY 1.6 01/21/25 GMTN	400	0	0	400 USD	96.77%	387'068.00	0.02	a)
US78016EZD20	3.6250 % RY 3 5/8 05/04/27	500	0	0	500 USD	95.86%	479'323.00	0.03	a)
US78016EZM29	0.8750 % RY 0 7/8 01/20/26 GMTN	500	0	0	500 USD	92.62%	463'108.00	0.03	a)
US78016EZZ32	1.4000 % RY 1.4 11/02/26 GMTN	250	0	0	250 USD	90.91%	227'279.00	0.01	a)
US78016FZQ08	3.8750 % RY 3 7/8 05/04/32	400	0	0	400 USD	91.78%	367'108.80	0.02	a)
US78016FZT47	4.8750 % RY 4 7/8 01/12/26 GMTN	0	250	0	250 USD	99.60%	248'998.75	0.02	a)
US78016FZU10	6.0000 % RY 6 11/01/27 MTN	400	0	0	400 USD	103.06%	412'236.40	0.03	a)
US78016FZW75	4.9000 % RY 4.9 01/12/28 GMTN	0	400	0	400 USD	99.63%	398'532.80	0.02	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	400	200	0	600 USD	98.28%	589'708.80	0.04	a)
US78016FZY32	4.9500 % RY 4.95 04/25/25 GMTN	0	400	0	400 USD	99.63%	398'520.40	0.02	a)
US78016FZZ07	5.2000 % RY 5.2 07/20/26 GMTN	0	280	0	280 USD	100.34%	280'945.00	0.02	a)
US78016HZQ63	5.0000 % RY 5 05/02/33 GMTN	0	200	0	200 USD	98.21%	196'418.60	0.01	a)
US78016HZS20	5.2000 % RY 5.2 08/01/28 GMTN	0	300	0	300 USD	100.63%	301'899.90	0.02	a)
US780641AH94	8.3750 % KPN 8 3/8 10/01/30	0	500	0	500 USD	116.60%	582'988.00	0.04	a)
US78355HKN88	2.5000 % R 2 1/2 09/01/24 MTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78355HKV05	5.6500 % R 5.65 03/01/28 MTN	0	150	0	150 USD	101.70%	152'553.45	0.01	a)
US78355HKW87	5.2500 % R 5 1/4 06/01/28 MTN	0	200	0	200 USD	100.06%	200'125.80	0.01	a)
US78355HKY44	6.6000 % R 6.6 12/01/33	0	200	0	200 USD	106.82%	213'630.40	0.01	a)
US78409VAQ77	3.2500 % SPGI 3 1/4 12/01/49	500	0	0	500 USD	71.38%	356'916.50	0.02	a)
US78409VAR50	2.3000 % SPGI 2.3 08/15/60	250	0	0	250 USD	54.03%	135'068.25	0.01	a)
US78409VAY02	4.7500 % SPGI 4 3/4 08/01/28 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78409VAZ76	4.2500 % SPGI 4 1/4 05/01/29 144A	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78409VBF04	4.7500 % SPGI 4 3/4 08/01/28	0	200	0	200 USD	99.66%	199'325.60	0.01	a)
US78409VBG86	4.2500 % SPGI 4 1/4 05/01/29	0	500	0	500 USD	97.07%	485'355.00	0.03	a)
US78409VBH69	2.4500 % SPGI 2.45 03/01/27	0	350	0	350 USD	93.21%	326'240.25	0.02	a)
US78409VBJ26	2.7000 % SPGI 2.7 03/01/29	0	250	0	250 USD	90.54%	226'349.50	0.01	a)
US78409VBK98	2.9000 % SPGI 2.9 03/01/32	0	400	0	400 USD	86.06%	344'253.20	0.02	a)
US78409VBL71	3.7000 % SPGI 3.7 03/01/52	0	300	0	300 USD	77.42%	232'257.90	0.01	a)
US78409VBM54	3.9000 % SPGI 3.9 03/01/62	0	200	0	200 USD	77.60%	155'192.60	0.01	a)
US78409VBP85	5.2500 % SPGI 5 1/4 09/15/33 144A	0	200	0	200 USD	100.89%	201'776.40	0.01	a)
US785592AJ58	5.7500 % SPLLLC 5 3/4 05/15/24	500	0	412	88 USD	99.97%	87'970.08	0.01	a)
US785592AM87	5.6250 % SPLLLC 5 5/8 03/01/25	1'000	0	0	1'000 USD	99.75%	997'500.00	0.06	a)
US785592AS57	5.0000 % SPLLLC 5 03/15/27	500	0	0	500 USD	99.25%	496'250.00	0.03	a)
US785592AV86	5.8750 % SPLLLC 5 7/8 06/30/26	500	0	0	500 USD	100.75%	503'750.00	0.03	a)
US79466LAF13	3.7000 % CRM 3.7 04/11/28	0	500	0	500 USD	96.37%	481'830.50	0.03	a)
US79466LAH78	1.5000 % CRM 1 1/2 07/15/28	0	300	0	300 USD	87.48%	262'447.50	0.02	a)
US79466LAJ35	1.9500 % CRM 1.95 07/15/31	0	465	0	465 USD	81.98%	381'213.98	0.02	a)
US79466LAK08	2.7000 % CRM 2.7 07/15/41	0	390	0	390 USD	71.33%	278'176.47	0.02	a)
US79466LAL80	2.9000 % CRM 2.9 07/15/51	0	620	0	620 USD	66.44%	411'906.92	0.03	a)
US79466LAM63	3.0500 % CRM 3.05 07/15/61	0	390	0	390 USD	64.38%	251'099.55	0.02	a)
US797440CC60	3.7000 % SRE 3.7 03/15/52	0	150	0	150 USD	74.68%	112'021.65	0.01	a)
US797440CD44	5.3500 % SRE 5.35 04/01/53	0	200	0	200 USD	97.50%	195'008.20	0.01	a)
US797440CE27	4.9500 % SRE 4.95 08/15/28	0	200	0	200 USD	99.87%	199'730.40	0.01	a)
US80007RAE53	5.4000 % SANLTD 5.4 08/08/28	200	0	0	200 USD	97.13%	194'250.00	0.01	a)
US80007RAF29	5.1250 % SANLTD 5 1/8 08/08/25	800	0	0	800 USD	98.13%	785'000.00	0.05	a)
US80007RAK14	4.0500 % SANLTD 3.8 01/08/26	500	0	0	500 USD	95.75%	478'750.00	0.03	a)
US80007RAL96	4.6250 % SANLTD 4 3/8 06/18/30	500	0	0	500 USD	90.75%	453'750.00	0.03	a)
US801060AD60	3.6250 % SANFP 3 5/8 06/19/28	500	0	0	500 USD	96.36%	481'815.50	0.03	a)
US80281LAG05	3.8230 % SANUK 3.823 11/03/28	400	0	0	400 USD	93.11%	372'434.00	0.02	a)
US80281LAN55	1.0890 % SANUK 1.089 03/15/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80281LAP04	2.8960 % SANUK 2.896 03/15/32	0	200	0	200 USD	84.35%	168'690.60	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US80281LAQ86	1.6730 % SANUK 1.673 06/14/27	500	0	0	500 USD	90.70%	453'504.50	0.03	a)
US80281LAR69	2.4690 % SANUK 2.469 01/11/28	0	200	0	200 USD	90.80%	181'605.60	0.01	a)
US80281LAS43	6.8330 % SANUK 6.833 11/21/26	0	400	0	400 USD	101.24%	404'953.20	0.03	a)
US80281LAT26	6.5340 % SANUK 6.534 01/10/29	0	300	0	300 USD	102.10%	306'298.20	0.02	a)
US80282KAE64	4.5000 % SANUSA 4 1/2 07/17/25	1'000	0	0	1'000 USD	98.00%	979'978.00	0.06	a)
US80282KAP12	4.4000 % SANUSA 4.4 07/13/27	500	0	0	500 USD	96.05%	480'259.00	0.03	a)
US80282KAW62	3.5000 % SANUSA 3 1/2 06/07/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KAZ93	3.2440 % SANUSA 3.244 10/05/26	500	0	0	500 USD	93.66%	468'291.50	0.03	a)
US80282KBB17	3.4500 % SANUSA 3.45 06/02/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.99%	969'903.00	0.06	a)
US80282KBC99	2.4900 % SANUSA 2.49 01/06/28	0	500	0	500 USD	90.43%	452'132.00	0.03	a)
US80282KBG04	6.5650 % SANUSA 6.565 06/12/29	0	250	0	250 USD	101.37%	253'430.00	0.02	a)
US80283LAJ26	4.0000 % SANUK 4 03/13/24	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US806605AG68	6.5000 % MRK 6 1/2 12/01/33	500	0	0	500 USD	112.38%	561'913.50	0.04	a)
US806854AJ48	2.6500 % SLB 2.65 06/26/30	300	0	0	300 USD	87.85%	263'562.60	0.02	a)
US806854AK11	4.5000 % SLB 4 1/2 05/15/28	0	150	0	150 USD	98.92%	148'373.85	0.01	a)
US806854AL93	4.8500 % SLB 4.85 05/15/33	0	150	0	150 USD	98.89%	148'342.20	0.01	a)
US808513AU91	3.2000 % SCHW 3.2 01/25/28	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BB02	4.2000 % SCHW 4.2 03/24/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BF16	0.9000 % SCHW 0.9 03/11/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BP97	2.0000 % SCHW 2 03/20/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BS37	2.3000 % SCHW 2.3 05/13/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BW49	3.3000 % SCHW 3.3 04/01/27	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513BY05	2.4500 % SCHW 2.45 03/03/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US808513CA10	2.9000 % SCHW 2.9 03/03/32	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US816851AP42	6.0000 % SRE 6 10/15/39	300	0	0	300 USD	100.80%	302'403.30	0.02	a)
US816851BG34	3.4000 % SRE 3.4 02/01/28	1'800	0	0	1'800 USD	93.75%	1'687'492.80	0.11	a)
US816851BH17	3.8000 % SRE 3.8 02/01/38	500	0	0	500 USD	81.96%	409'788.00	0.03	a)
US816851BJ72	4.0000 % SRE 4 02/01/48	700	0	0	700 USD	78.23%	547'584.80	0.03	a)
US816851BM02	4.1250 % SRE 4 1/8 04/01/52	0	200	0	200 USD	91.75%	183'500.00	0.01	a)
US816851BQ16	5.4000 % SRE 5.4 08/01/26	0	200	0	200 USD	100.22%	200'448.60	0.01	a)
US816851BR98	5.5000 % SRE 5 1/2 08/01/33	0	200	0	200 USD	99.28%	198'559.80	0.01	a)
US81762PAE25	1.4000 % NOW 1.4 09/01/30	500	0	0	500 USD	80.09%	400'464.50	0.03	a)
US822582AD40	6.3750 % RDSALN 6 3/8 12/15/38	660	200	0	860 USD	111.48%	958'764.98	0.06	a)
US822582AN22	5.5000 % RDSALN 5 1/2 03/25/40	230	0	0	230 USD	103.12%	237'183.82	0.01	a)
US822582AT91	3.6250 % RDSALN 3 5/8 08/21/42	570	0	0	570 USD	81.02%	461'820.27	0.03	a)
US822582BD31	3.2500 % RDSALN 3 1/4 05/11/25	950	0	0	950 USD	97.86%	929'638.65	0.06	a)
US822582BE14	4.1250 % RDSALN 4 1/8 05/11/35	300	0	0	300 USD	92.44%	277'318.80	0.02	a)
US822582BF88	4.3750 % RDSALN 4 3/8 05/11/45	800	0	0	800 USD	87.92%	703'375.20	0.04	a)
US822582BQ44	4.0000 % RDSALN 4 05/10/46	500	100	0	600 USD	81.45%	488'693.40	0.03	a)
US822582BT82	2.8750 % RDSALN 2 7/8 05/10/26	500	0	0	500 USD	95.78%	478'897.50	0.03	a)
US822582BX94	2.5000 % RDSALN 2 1/2 09/12/26	500	0	0	500 USD	94.45%	472'268.50	0.03	a)
US822582BY77	3.7500 % RDSALN 3 3/4 09/12/46	200	120	0	320 USD	79.15%	253'285.44	0.02	a)
US822582CC49	2.0000 % RDSALN 2 11/07/24	500	0	0	500 USD	97.87%	489'340.00	0.03	a)
US822582CE05	3.1250 % RDSALN 3 1/8 11/07/49	0	500	0	500 USD	69.89%	349'425.00	0.02	a)
US822582CG52	2.7500 % RDSALN 2 3/4 04/06/30	500	0	0	500 USD	89.05%	445'238.00	0.03	a)
US822582CH36	3.2500 % RDSALN 3 1/4 04/06/50	500	0	0	500 USD	71.37%	356'848.50	0.02	a)
US822582CK64	2.8750 % RDSALN 2 7/8 11/26/41	200	0	0	200 USD	72.82%	145'634.20	0.01	a)
US822582CL48	3.0000 % RDSALN 3 11/26/51	400	0	0	400 USD	66.91%	267'629.60	0.02	a)
US824348AW63	3.4500 % SHW 3.45 06/01/27	0	400	0	400 USD	95.16%	380'641.60	0.02	a)
US824348AX47	4.5000 % SHW 4 1/2 06/01/47	0	400	0	400 USD	86.21%	344'833.60	0.02	a)
US824348BJ44	2.9500 % SHW 2.95 08/15/29	0	200	0	200 USD	89.75%	179'491.20	0.01	a)
US824348BK17	3.8000 % SHW 3.8 08/15/49	0	300	0	300 USD	78.08%	234'236.40	0.01	a)
US824348BL99	2.3000 % SHW 2.3 05/15/30	0	150	0	150 USD	84.80%	127'202.70	0.01	a)
US824348BM72	3.3000 % SHW 3.3 05/15/50	0	250	0	250 USD	70.16%	175'390.25	0.01	a)
US824348BN55	2.2000 % SHW 2.2 03/15/32	0	250	0	250 USD	80.80%	201'991.25	0.01	a)
US824348BP04	2.9000 % SHW 2.9 03/15/52	0	250	0	250 USD	64.34%	160'839.75	0.01	a)
US82460CAR51	4.3750 % SHNHAN 4 3/8 04/13/32 144A	0	200	0	200 USD	91.74%	183'471.00	0.01	a)
US82481LAD10	3.2000 % TACHEM 3.2 09/23/26	500	300	0	800 USD	95.13%	761'000.00	0.05	a)
US828807CE50	6.7500 % SPG 6 3/4 02/01/40	300	0	0	300 USD	111.03%	333'098.10	0.02	a)
US828807CS47	3.3750 % SPG 3 3/8 10/01/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US828807CV75	3.5000 % SPG 3 1/2 09/01/25	500	0	0	500 USD	97.53%	487'625.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US828807CW58	3.3000 % SPG 3.3 01/15/26	250	0	0	250 USD	96.50%	241'237.50	0.02	a)
US828807CZ89	4.2500 % SPG 4 1/4 11/30/46	0	300	0	300 USD	81.74%	245'213.10	0.02	a)
US828807DC85	3.3750 % SPG 3 3/8 06/15/27	250	0	0	250 USD	94.81%	237'015.00	0.01	a)
US828807DF17	2.4500 % SPG 2.45 09/13/29	500	0	0	500 USD	87.24%	436'184.00	0.03	a)
US828807DG99	2.0000 % SPG 2 09/13/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US828807DH72	3.2500 % SPG 3 1/4 09/13/49	500	0	0	500 USD	69.94%	349'723.00	0.02	a)
US828807DJ39	3.8000 % SPG 3.8 07/15/50	500	0	0	500 USD	75.90%	379'502.50	0.02	a)
US828807DK02	2.6500 % SPG 2.65 07/15/30	500	0	0	500 USD	86.67%	433'344.00	0.03	a)
US828807DM67	2.2000 % SPG 2.2 02/01/31	250	0	0	250 USD	82.22%	205'553.25	0.01	a)
US828807DU83	5.5000 % SPG 5 1/2 03/08/33	0	200	0	200 USD	100.55%	201'099.80	0.01	a)
US828807DV66	5.8500 % SPG 5.85 03/08/53	0	300	0	300 USD	100.78%	302'347.50	0.02	a)
US828807DW40	6.2500 % SPG 6 1/4 01/15/34	0	200	0	200 USD	105.14%	210'276.80	0.01	a)
US828807DX23	6.6500 % SPG 6.65 01/15/54	0	300	0	300 USD	113.10%	339'286.80	0.02	a)
US83088MAK80	1.8000 % SWKS 1.8 06/01/26	500	0	0	500 USD	92.48%	462'407.00	0.03	a)
US83192PAA66	2.0320 % SNLN 2.032 10/14/30	0	290	290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AK43	3.5000 % SJM 3 1/2 03/15/25	500	0	0	500 USD	97.96%	489'804.50	0.03	a)
US832696AM09	4.2500 % SJM 4 1/4 03/15/35	0	150	0	150 USD	89.41%	134'109.00	0.01	a)
US832696AP30	4.3750 % SJM 4 3/8 03/15/45	0	200	0	200 USD	82.69%	165'389.80	0.01	a)
US832696AR95	3.3750 % SJM 3 3/8 12/15/27	200	0	0	200 USD	94.23%	188'456.40	0.01	a)
US832696AS78	2.3750 % SJM 2 3/8 03/15/30	0	100	0	100 USD	85.83%	85'831.70	0.01	a)
US832696AU25	2.1250 % SJM 2 1/8 03/15/32	500	0	0	500 USD	79.55%	397'771.50	0.02	a)
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	0	220	0	220 USD	103.01%	226'612.76	0.01	a)
US832696AX63	6.2000 % SJM 6.2 11/15/33	0	300	0	300 USD	105.46%	316'378.50	0.02	a)
US832696AY47	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/43	0	220	0	220 USD	106.69%	234'711.40	0.01	a)
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	0	300	0	300 USD	108.31%	324'930.60	0.02	a)
US833034AM32	3.1000 % SNA 3.1 05/01/50	200	0	0	200 USD	69.89%	139'785.00	0.01	a)
US835495AL63	3.1250 % SON 3 1/8 05/01/30	200	0	0	200 USD	88.75%	177'493.00	0.01	a)
US835495AP77	2.8500 % SON 2.85 02/01/32	200	150	0	350 USD	84.10%	294'350.00	0.02	a)
US837004CJ73	5.1000 % D 5.1 06/01/65	250	0	0	250 USD	92.42%	231'044.00	0.01	a)
US842400ES88	6.0000 % EIX 6 01/15/34	0	100	0	100 USD	104.03%	104'030.00	0.01	a)
US842400FH15	5.9500 % EIX 5.95 02/01/38 08A	230	0	0	230 USD	102.03%	234'676.59	0.01	a)
US842400FL27	6.0500 % EIX 6.05 03/15/39	250	0	0	250 USD	102.95%	257'375.75	0.02	a)
US842400FP31	5.5000 % EIX 5 1/2 03/15/40	100	0	0	100 USD	99.06%	99'059.20	0.01	a)
US842400FQ14	4.5000 % EIX 4 1/2 09/01/40	0	200	0	200 USD	86.98%	173'950.20	0.01	a)
US842400FZ13	4.6500 % EIX 4.65 10/01/43	250	0	0	250 USD	87.49%	218'729.50	0.01	a)
US842400GG23	4.0000 % EIX 4 04/01/47	500	0	0	500 USD	77.93%	389'664.50	0.02	a)
US842400GK35	4.1250 % EIX 4 1/8 03/01/48 C	500	0	0	500 USD	80.39%	401'965.50	0.03	a)
US842400GN73	3.7000 % EIX 3.7 08/01/25 E	500	0	0	500 USD	97.66%	488'306.00	0.03	a)
US842400GR87	4.8750 % EIX 4 7/8 03/01/49 B	0	100	0	100 USD	88.84%	88'836.60	0.01	a)
US842400GT44	3.6500 % EIX 3.65 02/01/50	500	0	0	500 USD	73.20%	366'018.00	0.02	a)
US842400GY39	2.9500 % EIX 2.95 02/01/51 20A	0	100	0	100 USD	64.37%	64'367.60	0.00	a)
US842400HB27	1.1000 % EIX 1.1 04/01/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US842400HM81	2.7500 % EIX 2 3/4 02/01/32	450	0	0	450 USD	84.08%	378'347.40	0.02	a)
US842400HN64	3.4500 % EIX 3.45 02/01/52	400	0	0	400 USD	69.61%	278'452.40	0.02	a)
US842400HS51	5.8500 % EIX 5.85 11/01/27	0	200	0	200 USD	102.26%	204'525.80	0.01	a)
US842400HT35	5.9500 % EIX 5.95 11/01/32	0	200	0	200 USD	104.15%	208'293.20	0.01	a)
US842400HX47	5.8750 % EIX 5 7/8 12/01/53	0	400	0	400 USD	100.98%	403'911.60	0.03	a)
US842400HY20	5.6500 % EIX 5.65 10/01/28	0	600	0	600 USD	102.41%	614'458.80	0.04	a)
US842434CX83	6.3500 % SRE 6.35 11/15/52	300	0	0	300 USD	110.05%	330'154.80	0.02	a)
US842434CZ32	5.2000 % SRE 5.2 06/01/33	0	200	0	200 USD	98.98%	197'960.20	0.01	a)
US84265VAE56	6.7500 % SCCO 6 3/4 04/16/40	510	0	0	510 USD	109.00%	555'900.00	0.03	a)
US84265VAG05	5.2500 % SCCO 5 1/4 11/08/42	500	0	0	500 USD	94.00%	470'000.00	0.03	a)
US84265VAH87	3.8750 % SCCO 3 7/8 04/23/25	500	0	0	500 USD	97.75%	488'750.00	0.03	a)
US84265VAJ44	5.8750 % SCCO 5 7/8 04/23/45	1'150	0	0	1'150 USD	99.65%	1'145'976.15	0.07	a)
US843646AM23	4.1500 % SO 4.15 12/01/25	0	500	0	500 USD	98.24%	491'210.00	0.03	a)
US844741BF49	2.6250 % LUV 2 5/8 02/10/30	250	0	0	250 USD	86.63%	216'562.50	0.01	a)
US844741BJ60	5.2500 % LUV 5 1/4 05/04/25	400	0	0	400 USD	99.74%	398'952.80	0.02	a)
US844741BK34	5.1250 % LUV 5 1/8 06/15/27	500	0	0	500 USD	99.62%	498'111.00	0.03	a)
US845011AE58	4.0500 % SWX 4.05 03/15/32	0	600	0	600 USD	91.21%	547'264.20	0.03	a)
US84756NAD12	4.7500 % ENBCN 4 3/4 03/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US84756NAF69	3.5000 % ENBCN 3 1/2 03/15/25	750	0	0	750 USD	97.90%	734'217.75	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 USD	in % 7)	Kat.
US84756NAG43	4.5000 % ENBCN 4 1/2 03/15/45	500	0	0	500 USD	83.79%	418'930.50	0.03	a)
US84756NAH26	3.3750 % ENBCN 3 3/8 10/15/26	300	0	0	300 USD	95.58%	286'735.20	0.02	a)
US852060AD48	6.8750 % S 6 7/8 11/15/28	700	100	0	800 USD	106.75%	854'000.00	0.05	a)
US852060AT99	8.7500 % S 8 3/4 03/15/32	600	600	0	1'200 USD	120.88%	1'450'500.00	0.09	a)
US85207UAI43	7.6250 % S 7 5/8 02/15/25	500	100	0	600 USD	101.00%	606'000.00	0.04	a)
US85207UAK16	7.6250 % S 7 5/8 03/01/26	500	100	0	600 USD	103.38%	620'250.00	0.04	a)
US854502AH46	4.2500 % SWK 4 1/4 11/15/28	0	150	0	150 USD	96.31%	144'468.75	0.01	a)
US854502AM31	4.0000 % SWK 4 03/15/60	1'500	0	0	1'500 USD	88.25%	1'323'750.00	0.08	a)
US854502AN14	2.7500 % SWK 2 3/4 11/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	57.95%	579'457.00	0.04	a)
US854502AP61	2.3000 % SWK 2.3 02/24/25	200	0	0	200 USD	96.94%	193'879.20	0.01	a)
US854502AQ45	3.0000 % SWK 3 05/15/32	0	150	0	150 USD	83.80%	125'704.20	0.01	a)
US855244AM15	3.7500 % SBUX 3 3/4 12/01/47	400	0	0	400 USD	76.54%	306'167.20	0.02	a)
US855244AN97	3.1000 % SBUX 3.1 03/01/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US855244AV14	2.0000 % SBUX 2 03/12/27	500	0	0	500 USD	91.54%	457'677.00	0.03	a)
US855244AW96	2.2500 % SBUX 2 1/4 03/12/30	1'000	0	0	1'000 USD	85.44%	854'381.00	0.05	a)
US855244AX79	3.3500 % SBUX 3.35 03/12/50	500	0	0	500 USD	70.27%	351'335.00	0.02	a)
US855244AZ28	2.5500 % SBUX 2.55 11/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	85.81%	858'105.00	0.05	a)
US855244BA67	3.5000 % SBUX 3 1/2 11/15/50	1'000	0	0	1'000 USD	73.30%	733'018.00	0.05	a)
US855244BC24	3.0000 % SBUX 3 02/14/32	250	0	0	250 USD	86.48%	216'193.00	0.01	a)
US855244BE89	4.7500 % SBUX 4 3/4 02/15/26	0	300	0	300 USD	99.24%	297'719.70	0.02	a)
US857477AT04	3.5500 % STT 3.55 08/18/25	250	0	0	250 USD	97.78%	244'451.25	0.02	a)
US857477AW33	2.6500 % STT 2.65 05/19/26	600	0	0	600 USD	95.12%	570'730.20	0.04	a)
US857477BD43	4.1410 % STT 4.141 12/03/29	500	0	0	500 USD	95.71%	478'561.50	0.03	a)
US857477BE26	2.3540 % STT 2.354 11/01/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US857477BG73	2.4000 % STT 2.4 01/24/30	500	0	0	500 USD	87.36%	436'800.50	0.03	a)
US857477BP72	2.2000 % STT 2.2 03/03/31	500	0	0	500 USD	82.34%	411'698.50	0.03	a)
US857477BQ55	1.6840 % STT 1.684 11/18/27	0	150	0	150 USD	91.68%	137'527.20	0.01	a)
US857477BT94	2.6230 % STT 2.623 02/07/33	0	150	0	150 USD	82.86%	124'284.00	0.01	a)
US857477BY89	5.8200 % STT 5.82 11/04/28	300	0	0	300 USD	102.26%	306'781.20	0.02	a)
US857477BZ54	4.8570 % STT 4.857 01/26/26	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US857477CA94	4.8210 % STT 4.821 01/26/34	0	200	0	200 USD	96.17%	192'332.00	0.01	a)
US857477CB77	5.1040 % STT 5.104 05/18/26	0	300	0	300 USD	99.62%	298'856.40	0.02	a)
US857477CC50	5.1590 % STT 5.159 05/18/34	0	450	0	450 USD	98.88%	444'951.90	0.03	a)
US857477CF81	5.6840 % STT 5.684 11/21/29	0	300	0	300 USD	102.36%	307'086.60	0.02	a)
US85771PAC68	5.1000 % EQNR 5.1 08/17/40	270	0	0	270 USD	97.88%	264'262.50	0.02	a)
US85771PAL67	3.9500 % EQNR 3.95 05/15/43	350	0	0	350 USD	83.25%	291'375.00	0.02	a)
US85771PAN24	3.7000 % EQNR 3.7 03/01/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US85771PAQ54	4.8000 % EQNR 4.8 11/08/43	250	0	0	250 USD	94.00%	235'000.00	0.01	a)
US85771PAX06	3.2500 % EQNR 3 1/4 11/10/24	200	0	0	200 USD	98.59%	197'184.00	0.01	a)
US858119BM10	3.2500 % STLD 3 1/4 01/15/31	0	410	0	410 USD	88.50%	362'850.00	0.02	a)
US85917PAA57	2.7000 % STE 2.7 03/15/31	250	0	0	250 USD	84.81%	212'034.50	0.01	a)
US85917PAB31	3.7500 % STE 3 3/4 03/15/51	250	150	0	400 USD	73.47%	293'873.60	0.02	a)
US863667AJ04	4.6250 % SYK 4 5/8 03/15/46	0	300	0	300 USD	91.53%	274'590.30	0.02	a)
US863667AN16	3.5000 % SYK 3 1/2 03/15/26	400	0	0	400 USD	96.93%	387'734.00	0.02	a)
US863667AQ47	3.6500 % SYK 3.65 03/07/28	300	0	0	300 USD	95.30%	285'913.50	0.02	a)
US863667AY70	1.9500 % SYK 1.95 06/15/30	400	0	0	400 USD	83.78%	335'102.80	0.02	a)
US863667AZ46	2.9000 % SYK 2.9 06/15/50	0	290	0	290 USD	68.10%	197'483.04	0.01	a)
US863667BA85	1.1500 % SYK 1.15 06/15/25	300	0	0	300 USD	94.78%	284'330.10	0.02	a)
US863667BC42	4.8500 % SYK 4.85 12/08/28	0	200	0	200 USD	99.34%	198'673.80	0.01	a)
US865622BN30	3.4000 % SUMIBK 3.4 07/11/24 GMTN	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MAC47	3.7840 % SUMIBK 3.784 03/09/26	0	300	0	300 USD	97.30%	291'898.80	0.02	a)
US86562MAF77	2.6320 % SUMIBK 2.632 07/14/26	0	600	0	600 USD	94.44%	566'620.80	0.04	a)
US86562MAK62	3.0100 % SUMIBK 3.01 10/19/26	0	430	0	430 USD	94.84%	407'794.80	0.03	a)
US86562MAN02	3.4460 % SUMIBK 3.446 01/11/27	0	400	0	400 USD	95.77%	383'086.40	0.02	a)
US86562MAR16	3.3640 % SUMIBK 3.364 07/12/27	0	450	0	450 USD	94.84%	426'780.00	0.03	a)
US86562MAV28	3.3520 % SUMIBK 3.352 10/18/27	0	150	0	150 USD	94.36%	141'535.50	0.01	a)
US86562MBC38	3.9440 % SUMIBK 3.944 07/19/28	0	200	0	200 USD	95.75%	191'500.00	0.01	a)
US86562MBG42	4.3060 % SUMIBK 4.306 10/16/28	0	200	0	200 USD	97.99%	195'975.40	0.01	a)
US86562MBP41	3.0400 % SUMIBK 3.04 07/16/29	0	800	0	800 USD	89.56%	716'453.60	0.04	a)
US86562MBV19	2.3480 % SUMIBK 2.348 01/15/25	0	500	0	500 USD	97.45%	487'235.00	0.03	a)
US86562MBW91	2.7500 % SUMIBK 2 3/4 01/15/30	0	400	0	400 USD	87.55%	350'202.40	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 USD	in % 7)	Kat.
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	0	650	0	650 USD	95.01%	617'535.10	0.04	a)
US86562MCB46	2.1300 % SUMIBK 2.13 07/08/30	0	500	0	500 USD	83.24%	416'193.00	0.03	a)
US86562MCD02	0.9480 % SUMIBK 0.948 01/12/26	0	220	0	220 USD	92.53%	203'555.44	0.01	a)
US86562MCE84	1.7100 % SUMIBK 1.71 01/12/31	0	250	0	250 USD	79.76%	199'409.75	0.01	a)
US86562MCF59	2.2960 % SUMIBK 2.296 01/12/41	0	200	0	200 USD	67.48%	134'968.20	0.01	a)
US86562MCG33	1.9020 % SUMIBK 1.902 09/17/28	0	400	0	400 USD	86.69%	346'770.80	0.02	a)
US86562MCH16	1.4020 % SUMIBK 1.402 09/17/26	0	500	0	500 USD	91.06%	455'315.50	0.03	a)
US86562MCJ71	2.2220 % SUMIBK 2.222 09/17/31	0	290	0	290 USD	81.28%	235'700.11	0.01	a)
US86562MCK45	2.9300 % SUMIBK 2.93 09/17/41	0	240	0	240 USD	73.97%	177'521.76	0.01	a)
US86562MCN83	2.4720 % SUMIBK 2.472 01/14/29	0	200	0	200 USD	88.42%	176'840.60	0.01	a)
US86562MCQ15	3.0500 % SUMIBK 3.05 01/14/42	0	200	0	200 USD	75.54%	151'088.20	0.01	a)
US86562MCR97	5.5200 % SUMIBK 5.52 01/13/28	0	500	0	500 USD	101.64%	508'220.00	0.03	a)
US86562MCS70	5.7660 % SUMIBK 5.766 01/13/33	0	650	0	650 USD	103.44%	672'339.20	0.04	a)
US86562MCT53	5.4640 % SUMIBK 5.464 01/13/26	0	650	0	650 USD	100.02%	650'150.80	0.04	a)
US86562MCW82	5.7100 % SUMIBK 5.71 01/13/30	0	400	0	400 USD	102.52%	410'073.20	0.03	a)
US86562MCY49	6.1840 % SUMIBK 6.184 07/13/43	0	280	0	280 USD	109.41%	306'334.28	0.02	a)
US86562MDA53	5.8800 % SUMIBK 5.88 07/13/26	0	400	0	400 USD	101.29%	405'146.00	0.03	a)
US86562MDB37	5.8000 % SUMIBK 5.8 07/13/28	0	300	0	300 USD	102.73%	308'198.10	0.02	a)
US86562MDC10	5.8520 % SUMIBK 5.852 07/13/30	0	200	0	200 USD	102.95%	205'907.20	0.01	a)
US86562MDD92	5.7760 % SUMIBK 5.776 07/13/33	0	200	0	200 USD	103.10%	206'206.40	0.01	a)
US86562MDG24	5.7160 % SUMIBK 5.716 09/14/28	0	350	0	350 USD	101.75%	356'116.25	0.02	a)
US86562MDJ62	5.8080 % SUMIBK 5.808 09/14/33	0	250	0	250 USD	103.63%	259'064.25	0.02	a)
US866677AH07	4.2000 % SUI 4.2 04/15/32	0	250	0	250 USD	88.88%	222'192.00	0.01	a)
US867224AE71	3.7500 % SUCN 3 3/4 03/04/51	0	220	0	220 USD	72.62%	159'754.32	0.01	a)
US867229AC03	7.1500 % SUCN 7.15 02/01/32	0	150	0	150 USD	109.47%	164'202.15	0.01	a)
US867229AE68	6.5000 % SUCN 6 1/2 06/15/38	100	0	0	100 USD	104.50%	104'497.50	0.01	a)
US86722TAB89	6.8500 % SUCN 6.85 06/01/39	500	0	0	500 USD	107.68%	538'399.00	0.03	a)
US86944BAJ26	3.3610 % SUTHEA 3.361 08/15/50 20A	0	200	0	200 USD	73.16%	146'317.60	0.01	a)
US86964WAF95	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29	500	0	0	500 USD	99.69%	498'446.00	0.03	a)
US86964WAH51	5.0000 % SUZANO 5 01/15/30	500	0	0	500 USD	94.89%	474'464.00	0.03	a)
US86964WAJ18	3.7500 % SUZANO 3 3/4 01/15/31	700	0	0	700 USD	87.36%	611'516.50	0.04	a)
US86964WAK80	3.1250 % SUZANO 3 1/8 01/15/32 DM3N	500	0	0	500 USD	81.90%	409'488.00	0.03	a)
US87162WAF77	1.7500 % SNX 1 3/4 08/09/26	0	200	0	200 USD	90.74%	181'485.40	0.01	a)
US87165BAD55	4.2500 % SYF 4 1/4 08/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87165BAL71	3.7000 % SYF 3.7 08/04/26	500	390	500	390 USD	94.43%	368'272.71	0.02	a)
US87165BAM54	3.9500 % SYF 3.95 12/01/27	500	130	500	130 USD	92.63%	120'421.21	0.01	a)
US87165BAP85	5.1500 % SYF 5.15 03/19/29	0	200	0	200 USD	95.52%	191'044.80	0.01	a)
US87165BAR42	2.8750 % SYF 2 7/8 10/28/31	400	100	400	100 USD	78.08%	78'084.60	0.00	a)
US87166FAD50	5.4000 % SYF 5.4 08/22/25 BKNT	0	300	0	300 USD	98.89%	296'677.50	0.02	a)
US87166FAE34	5.6250 % SYF 5 5/8 08/23/27	0	250	0	250 USD	96.97%	242'416.50	0.02	a)
US871829AY37	4.8500 % SYY 4.85 10/01/45	300	0	0	300 USD	89.78%	269'332.80	0.02	a)
US871829AZ02	3.7500 % SYY 3 3/4 10/01/25	250	0	0	250 USD	97.49%	243'718.50	0.02	a)
US871829BC08	3.3000 % SYY 3.3 07/15/26	250	0	0	250 USD	96.09%	240'227.00	0.02	a)
US871829BD80	4.5000 % SYY 4 1/2 04/01/46	400	0	0	400 USD	85.45%	341'808.00	0.02	a)
US871829BF39	3.2500 % SYY 3 1/4 07/15/27	200	0	0	200 USD	95.08%	190'151.60	0.01	a)
US871829BH94	4.4500 % SYY 4.45 03/15/48	0	200	0	200 USD	84.86%	169'719.00	0.01	a)
US871829BJ50	3.3000 % SYY 3.3 02/15/50	0	100	0	100 USD	70.84%	70'839.10	0.00	a)
US871829BL07	5.9500 % SYY 5.95 04/01/30	500	0	0	500 USD	104.14%	520'690.50	0.03	a)
US871829BN62	6.6000 % SYY 6.6 04/01/50	500	0	0	500 USD	113.06%	565'280.50	0.04	a)
US871829BR76	3.1500 % SYY 3.15 12/14/51	0	200	0	200 USD	67.70%	135'403.00	0.01	a)
US871829BS59	5.7500 % SYY 5 3/4 01/17/29	0	150	0	150 USD	102.17%	153'255.45	0.01	a)
US871829BT33	6.0000 % SYY 6 01/17/34	0	150	0	150 USD	105.11%	157'666.50	0.01	a)
US872540AQ25	2.2500 % TJX 2 1/4 09/15/26	300	0	0	300 USD	93.96%	281'887.20	0.02	a)
US87264AAV70	4.7500 % TMUS 4 3/4 02/01/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264AAX37	4.3750 % TMUS 4 3/8 04/15/40	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264AAZ84	4.5000 % TMUS 4 1/2 04/15/50	910	0	910	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABB08	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABD63	3.7500 % TMUS 3 3/4 04/15/27	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABF12	3.8750 % TMUS 3 7/8 04/15/30	2'180	0	2'180	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABL89	3.0000 % TMUS 3 02/15/41	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABN46	3.3000 % TMUS 3.3 02/15/51	500	370	870	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US87264ABV61	3.3750 % TMUS 3 3/8 04/15/29	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABW45	3.5000 % TMUS 3 1/2 04/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABX28	2.2500 % TMUS 2 1/4 11/15/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABY01	3.6000 % TMUS 3.6 11/15/60	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ABZ75	1.5000 % TMUS 1 1/2 02/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACA16	2.0500 % TMUS 2.05 02/15/28	0	512	512	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACB98	2.5500 % TMUS 2.55 02/15/31	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACQ67	2.7000 % TMUS 2.7 03/15/32	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACS24	2.4000 % TMUS 2.4 03/15/29	0	146	146	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACT07	3.4000 % TMUS 3.4 10/15/52	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACV52	5.2000 % TMUS 5.2 01/15/33	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACW36	5.6500 % TMUS 5.65 01/15/53	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACY91	5.0500 % TMUS 5.05 07/15/33	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ACZ66	4.9500 % TMUS 4.95 03/15/28	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADA07	4.8000 % TMUS 4.8 07/15/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADB89	5.7500 % TMUS 5 3/4 01/15/54	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADC62	5.7500 % TMUS 5 3/4 01/15/34	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADD46	6.0000 % TMUS 6 06/15/54	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US872898AA96	1.7500 % TAISEM 1 3/4 10/25/26	400	0	0	400 USD	91.88%	367'521.60	0.02	a)
US872898AC52	2.5000 % TAISEM 2 1/2 10/25/31	200	0	0	200 USD	84.38%	168'753.20	0.01	a)
US872898AD36	3.1250 % TAISEM 3 1/8 10/25/41	0	300	0	300 USD	78.99%	236'983.20	0.01	a)
US872898AF83	3.8750 % TAISEM 3 7/8 04/22/27	400	0	0	400 USD	96.84%	387'352.40	0.02	a)
US872898AH40	4.2500 % TAISEM 4 1/4 04/22/32	400	0	0	400 USD	96.73%	386'904.40	0.02	a)
US872898AJ06	4.5000 % TAISEM 4 1/2 04/22/52	400	0	0	400 USD	95.89%	383'576.00	0.02	a)
US874054AF63	3.5500 % TTWO 3.55 04/14/25	200	0	0	200 USD	97.93%	195'869.00	0.01	a)
US874054AG47	3.7000 % TTWO 3.7 04/14/27	200	0	0	200 USD	95.61%	191'212.80	0.01	a)
US874054AH20	4.0000 % TTWO 4 04/14/32	200	0	0	200 USD	91.52%	183'038.60	0.01	a)
US874054AJ85	5.0000 % TTWO 5 03/28/26	0	200	0	200 USD	99.45%	198'909.20	0.01	a)
US874054AK58	4.9500 % TTWO 4.95 03/28/28	0	150	0	150 USD	99.11%	148'657.50	0.01	a)
US874060AW64	5.0000 % TACHEM 5 11/26/28	400	0	0	400 USD	99.85%	399'398.80	0.02	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	500	200	0	700 USD	84.00%	587'979.00	0.04	a)
US874060AY21	3.0250 % TACHEM 3.025 07/09/40	800	0	0	800 USD	74.59%	596'752.80	0.04	a)
US874060AZ95	3.1750 % TACHEM 3.175 07/09/50	800	0	0	800 USD	68.64%	549'136.00	0.03	a)
US874060BD74	3.3750 % TACHEM 3 3/8 07/09/60	500	0	0	500 USD	66.73%	333'635.50	0.02	a)
US876030AA54	3.0500 % TPR 3.05 03/15/32	0	160	0	160 USD	81.09%	129'740.32	0.01	a)
US876030AB38	7.0500 % TPR 7.05 11/27/25	0	160	0	160 USD	101.88%	163'014.08	0.01	a)
US876030AC11	7.0000 % TPR 7 11/27/26	0	230	0	230 USD	102.74%	236'297.63	0.01	a)
US876030AD93	7.3500 % TPR 7.35 11/27/28	0	310	0	310 USD	104.66%	324'442.90	0.02	a)
US876030AE76	7.7000 % TPR 7.7 11/27/30	0	310	0	310 USD	105.93%	328'394.47	0.02	a)
US876030AF42	7.8500 % TPR 7.85 11/27/33	0	390	0	390 USD	108.23%	422'086.47	0.03	a)
US87612BBL53	6.5000 % TRGP 6 1/2 07/15/27	0	150	0	150 USD	101.00%	151'500.00	0.01	a)
US87612BBQ41	5.5000 % TRGP 5 1/2 03/01/30	0	200	0	200 USD	99.00%	198'000.00	0.01	a)
US87612BBS07	4.8750 % TRGP 4 7/8 02/01/31	0	100	0	100 USD	94.88%	94'875.00	0.01	a)
US87612BBU52	4.0000 % TRGP 4 01/15/32	0	300	0	300 USD	89.00%	267'000.00	0.02	a)
US87612EBA38	4.0000 % TGT 4 07/01/42	250	0	0	250 USD	86.02%	215'051.25	0.01	a)
US87612EBD76	3.5000 % TGT 3 1/2 07/01/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87612EBE59	2.5000 % TGT 2 1/2 04/15/26	0	250	0	250 USD	95.47%	238'665.00	0.01	a)
US87612EBF25	3.6250 % TGT 3 5/8 04/15/46	500	0	0	500 USD	77.89%	389'474.00	0.02	a)
US87612EBG08	3.9000 % TGT 3.9 11/15/47	1'000	0	0	1'000 USD	81.48%	814'836.00	0.05	a)
US87612EBH80	3.3750 % TGT 3 3/8 04/15/29	0	250	0	250 USD	93.95%	234'873.50	0.01	a)
US87612EBM75	1.9500 % TGT 1.95 01/15/27	500	0	0	500 USD	92.49%	462'454.00	0.03	a)
US87612EBP07	4.5000 % TGT 4 1/2 09/15/32	500	0	0	500 USD	96.79%	483'955.00	0.03	a)
US87612EBQ89	4.4000 % TGT 4.4 01/15/33	0	146	0	146 USD	96.46%	140'824.30	0.01	a)
US87612EBR62	4.8000 % TGT 4.8 01/15/53	0	400	0	400 USD	92.28%	369'133.20	0.02	a)
US87612GAA94	4.2000 % TRGP 4.2 02/01/33	0	200	0	200 USD	89.74%	179'471.20	0.01	a)
US87612GAB77	4.9500 % TRGP 4.95 04/15/52	0	200	0	200 USD	85.50%	170'992.40	0.01	a)
US87612GAC50	6.1250 % TRGP 6 1/8 03/15/33	0	400	0	400 USD	102.60%	410'391.60	0.03	a)
US87612GAD34	6.5000 % TRGP 6 1/2 02/15/53	0	400	0	400 USD	105.33%	421'336.40	0.03	a)
US87612GAE17	6.1500 % TRGP 6.15 03/01/29	0	700	0	700 USD	102.60%	718'183.20	0.04	a)
US87612GAF81	6.5000 % TRGP 6 1/2 03/30/34	0	300	0	300 USD	106.17%	318'495.00	0.02	a)
US87612KAA07	5.2000 % TRGP 5.2 07/01/27	0	300	0	300 USD	99.33%	297'980.70	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 USD	in % 7)	Kat.
US878742BG94	3.9000 % TCKBCN 3.9 07/15/30	0	150	0	150 USD	90.98%	136'465.35	0.01	a)
US879385AD49	8.2500 % TELEFO 8 1/4 09/15/30	720	0	0	720 USD	113.52%	817'329.60	0.05	a)
US87938WAC73	7.0450 % TELEFO 7.045 06/20/36	660	0	0	660 USD	109.95%	725'685.84	0.05	a)
US87938WAT09	4.1030 % TELEFO 4.103 03/08/27	400	0	0	400 USD	96.85%	387'400.00	0.02	a)
US87938WAW71	5.2130 % TELEFO 5.213 03/08/47	700	0	0	700 USD	89.74%	628'166.00	0.04	a)
US87938WAV54	4.6650 % TELEFO 4.665 03/06/38	0	200	0	200 USD	89.13%	178'260.40	0.01	a)
US87938WAW38	4.8950 % TELEFO 4.895 03/06/48	250	200	0	450 USD	85.69%	385'607.70	0.02	a)
US87938WAX11	5.5200 % TELEFO 5.52 03/01/49	500	150	0	650 USD	93.33%	606'624.85	0.04	a)
US87971MBD48	2.8000 % TCN 2.8 02/16/27	250	0	0	250 USD	93.27%	233'179.50	0.01	a)
US87971MBF95	3.7000 % TCN 3.7 09/15/27	500	0	0	500 USD	94.90%	474'512.00	0.03	a)
US87971MBH51	4.6000 % TCN 4.6 11/16/48	500	200	0	700 USD	85.35%	597'415.70	0.04	a)
US87971MBK80	4.3000 % TCN 4.3 06/15/49	0	300	0	300 USD	81.11%	243'336.00	0.02	a)
US87971MBW29	3.4000 % TCN 3.4 05/13/32	0	300	0	300 USD	86.99%	260'969.40	0.02	a)
US88034PAB58	2.0000 % TME 2 09/03/30	0	500	0	500 USD	81.27%	406'365.00	0.03	a)
US882508BC78	2.9000 % TXN 2.9 11/03/27	500	0	0	500 USD	93.95%	469'748.00	0.03	a)
US882508BD51	4.1500 % TXN 4.15 05/15/48	900	0	0	900 USD	85.05%	765'408.60	0.05	a)
US882508BH65	1.3750 % TXN 1 3/8 03/12/25	500	0	0	500 USD	96.23%	481'161.50	0.03	a)
US882508BV59	4.6000 % TXN 4.6 02/15/28	500	0	0	500 USD	99.79%	498'950.00	0.03	a)
US882508CC69	5.0000 % TXN 5 03/14/53	0	350	0	350 USD	96.82%	338'865.45	0.02	a)
US88339WAA45	3.5000 % WMB 3 1/2 10/15/51	250	0	0	250 USD	69.43%	173'580.50	0.01	a)
US883556CK68	1.7500 % TMO 1 3/4 10/15/28	0	250	0	250 USD	87.89%	219'731.75	0.01	a)
US883556CL42	2.0000 % TMO 2 10/15/31	0	400	0	400 USD	81.79%	327'161.20	0.02	a)
US883556CM25	2.8000 % TMO 2.8 10/15/41	0	500	0	500 USD	72.25%	361'247.50	0.02	a)
US883556CV24	4.9530 % TMO 4.953 08/10/26	0	300	0	300 USD	100.06%	300'193.20	0.02	a)
US883556CW07	4.9770 % TMO 4.977 08/10/30	0	400	0	400 USD	100.08%	400'309.60	0.02	a)
US883556CX89	5.0860 % TMO 5.086 08/10/33	0	500	0	500 USD	100.65%	503'240.00	0.03	a)
US883556CY62	5.4040 % TMO 5.404 08/10/43	0	250	0	250 USD	101.17%	252'927.50	0.02	a)
US883556DA77	5.0000 % TMO 5 01/31/29	0	500	0	500 USD	100.74%	503'707.00	0.03	a)
US884903BH70	5.8500 % TRICN 5.85 04/15/40	0	200	0	200 USD	101.77%	203'531.00	0.01	a)
US884903BV64	3.3500 % TRICN 3.35 05/15/26	250	0	0	250 USD	95.81%	239'533.75	0.01	a)
US88579EAC93	5.7000 % MMM 5.7 03/15/37 MTN	0	150	0	150 USD	103.70%	155'551.05	0.01	a)
US88579YAR27	3.0000 % MMM 3 08/07/25 MTN	700	0	0	700 USD	96.54%	675'795.40	0.04	a)
US88579YAV39	2.2500 % MMM 2 1/4 09/19/26 MTN	500	0	0	500 USD	92.82%	464'097.00	0.03	a)
US88579YAW12	3.1250 % MMM 3 1/8 09/19/46 MTN	0	200	0	200 USD	68.89%	137'771.00	0.01	a)
US88579YBJ91	2.3750 % MMM 2 3/8 08/26/29	700	0	0	700 USD	86.76%	607'332.60	0.04	a)
US88579YBK64	3.2500 % MMM 3 1/4 08/26/49	500	0	0	500 USD	69.01%	345'039.00	0.02	a)
US88579YBN04	3.0500 % MMM 3.05 04/15/30	500	0	0	500 USD	88.53%	442'661.50	0.03	a)
US88579YBP51	3.7000 % MMM 3.7 04/15/50	600	0	0	600 USD	74.39%	446'365.80	0.03	a)
US88732JAJ79	6.5500 % TWC 6.55 05/01/37	0	700	0	700 USD	93.82%	656'774.30	0.04	a)
US88732JAN81	7.3000 % TWC 7.3 07/01/38	0	400	0	400 USD	99.58%	398'332.40	0.02	a)
US88732JAY47	5.8750 % TWC 5 7/8 11/15/40	0	300	0	300 USD	86.04%	258'120.00	0.02	a)
US88732JBB35	5.5000 % TWC 5 1/2 09/01/41	0	100	0	100 USD	82.23%	82'232.50	0.01	a)
US88732JBD90	4.5000 % TWC 4 1/2 09/15/42	0	150	0	150 USD	73.24%	109'855.80	0.01	a)
US89114QCB23	3.2500 % TD 3 1/4 03/11/24 GMTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114QCH92	1.1500 % TD 1.15 06/12/25 MTN	500	0	0	500 USD	95.08%	475'400.00	0.03	a)
US89114QCK22	0.7500 % TD 0 3/4 09/11/25 MTN	250	0	0	250 USD	93.60%	233'991.25	0.01	a)
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	0	500	0	500 USD	91.67%	458'354.50	0.03	a)
US89114TZE53	0.7000 % TD 0.7 09/10/24 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	250	0	0	250 USD	91.09%	227'725.25	0.01	a)
US89114TZJ41	2.0000 % TD 2 09/10/31 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	81.37%	813'713.00	0.05	a)
US89114TZK14	1.2500 % TD 1 1/4 12/13/24	500	0	0	500 USD	96.79%	483'950.00	0.03	a)
US89114TZQ83	2.4500 % TD 2.45 01/12/32 GMTN	0	200	0	200 USD	82.15%	164'307.40	0.01	a)
US89114TZV78	3.2000 % TD 3.2 03/10/32 MTN	500	0	0	500 USD	87.38%	436'918.00	0.03	a)
US89115A2C54	4.1080 % TD 4.108 06/08/27	400	0	0	400 USD	97.00%	388'018.00	0.02	a)
US89115A2E11	4.4560 % TD 4.456 06/08/32	500	0	0	500 USD	95.45%	477'243.00	0.03	a)
US89115A2M37	5.1560 % TD 5.156 01/10/28	0	250	0	250 USD	100.21%	250'514.75	0.02	a)
US89115A2S07	5.5320 % TD 5.532 07/17/26 MTN	0	505	0	505 USD	100.89%	509'478.85	0.03	a)
US89115A2U52	5.5230 % TD 5.523 07/17/28 MTN	0	350	0	350 USD	101.47%	355'134.50	0.02	a)
US891160MJ94	3.6250 % TD 3 5/8 09/15/31	1'250	0	0	1'250 USD	96.09%	1'201'072.50	0.07	a)
US89152UAH59	3.8830 % TTEFP 3.883 10/11/28	1'000	0	0	1'000 USD	96.41%	964'086.00	0.06	a)
US89153VAL36	3.7500 % TTEFP 3 3/4 04/10/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US89153VAT61	2.8290 % TTEFP 2.829 01/10/30	500	0	0	500 USD	90.03%	450'131.50	0.03	a)
US89153VAU35	3.4610 % TTEFP 3.461 07/12/49	1'000	0	0	1'000 USD	74.27%	742'722.00	0.05	a)
US89153VAV18	3.1270 % TTEFP 3.127 05/29/50	500	0	0	500 USD	69.36%	346'803.50	0.02	a)
US891906AC37	4.8000 % GPN 4.8 04/01/26	0	500	0	500 USD	98.72%	493'582.50	0.03	a)
US892331AD13	3.6690 % TOYOTA 3.669 07/20/28	500	0	0	500 USD	97.22%	486'087.00	0.03	a)
US892331AG44	2.7600 % TOYOTA 2.76 07/02/29	1'000	0	0	1'000 USD	92.31%	923'093.00	0.06	a)
US892331AN94	2.3620 % TOYOTA 2.362 03/25/31	500	200	0	700 USD	86.26%	603'799.70	0.04	a)
US892331AP43	5.2750 % TOYOTA 5.275 07/13/26	0	140	0	140 USD	100.68%	140'951.58	0.01	a)
US892331AQ26	5.1180 % TOYOTA 5.118 07/13/28	0	140	0	140 USD	101.98%	142'776.34	0.01	a)
US892331AR09	5.1230 % TOYOTA 5.123 07/13/33	0	140	0	140 USD	104.97%	146'952.68	0.01	a)
US892356AA40	1.7500 % TSCO 1 3/4 11/01/30	0	200	0	200 USD	80.46%	160'923.60	0.01	a)
US892356AB23	5.2500 % TSCO 5 1/4 05/15/33	0	220	0	220 USD	99.26%	218'377.94	0.01	a)
US89236TEM36	3.0500 % TOYOTA 3.05 01/11/28 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	94.14%	941'446.00	0.06	a)
US89236TFS96	3.3500 % TOYOTA 3.35 01/08/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89236TGT60	1.8000 % TOYOTA 1.8 02/13/25 MTN	1'000	0	0	1'000 USD	96.74%	967'411.00	0.06	a)
US89236TGU34	2.1500 % TOYOTA 2.15 02/13/30 MTN	500	0	0	500 USD	85.81%	429'038.50	0.03	a)
US89236TGY55	3.3750 % TOYOTA 3 3/8 04/01/30 MTN	500	0	0	500 USD	91.92%	459'591.00	0.03	a)
US89236THP30	0.8000 % TOYOTA 0.8 10/16/25 MTN	500	0	0	500 USD	93.48%	467'390.00	0.03	a)
US89236THW80	0.8000 % TOYOTA 0.8 01/09/26 MTN	0	250	0	250 USD	92.65%	231'623.50	0.01	a)
US89236TJH95	0.5000 % TOYOTA 0 1/2 06/18/24 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89236TJK25	1.1250 % TOYOTA 1 1/8 06/18/26 MTN	250	0	0	250 USD	91.79%	229'465.25	0.01	a)
US89236TJN63	0.6250 % TOYOTA 0 5/8 09/13/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89236TJZ93	3.0500 % TOYOTA 3.05 03/22/27 MTN	500	0	0	500 USD	95.04%	475'214.50	0.03	a)
US89236TKD62	4.4500 % TOYOTA 4.45 06/29/29 MTN	0	250	0	250 USD	98.24%	245'609.50	0.02	a)
US89236TKL88	5.4500 % TOYOTA 5.45 11/10/27	200	0	0	200 USD	101.86%	203'727.20	0.01	a)
US89236TKN45	4.8000 % TOYOTA 4.8 01/10/25	0	300	0	300 USD	99.65%	298'962.00	0.02	a)
US89236TKR58	4.7000 % TOYOTA 4.7 01/12/33	0	200	0	200 USD	98.41%	196'815.40	0.01	a)
US89236TKT15	4.4500 % TOYOTA 4.45 05/18/26	0	350	0	350 USD	98.98%	346'422.65	0.02	a)
US89236TKU87	4.5500 % TOYOTA 4.55 05/17/30	0	200	0	200 USD	98.11%	196'212.20	0.01	a)
US89236TKX27	5.0000 % TOYOTA 5 08/14/26 MTN	0	300	0	300 USD	100.06%	300'170.70	0.02	a)
US89236TKZ74	5.6000 % TOYOTA 5.6 09/11/25	0	200	0	200 USD	100.83%	201'657.20	0.01	a)
US89236TLB97	5.2500 % TOYOTA 5 1/4 09/11/28 MTN	0	200	0	200 USD	101.53%	203'061.60	0.01	a)
US89236TLD53	5.4000 % TOYOTA 5.4 11/20/26	0	400	0	400 USD	101.16%	404'656.40	0.03	a)
US89236TLE37	5.5500 % TOYOTA 5.55 11/20/30	0	300	0	300 USD	103.30%	309'903.90	0.02	a)
US892938AA96	5.2500 % TT 5 1/4 03/03/33	0	200	0	200 USD	101.06%	202'113.40	0.01	a)
US8935268Z94	7.6250 % TRPCN 7 5/8 01/15/39	200	0	0	200 USD	116.37%	232'731.80	0.01	a)
US89352HAB50	5.8500 % TRPCN 5.85 03/15/36	50	0	0	50 USD	100.11%	50'052.95	0.00	a)
US89352HAL33	5.0000 % TRPCN 5 10/16/43	350	0	0	350 USD	89.39%	312'864.65	0.02	a)
US89352HAM16	4.6250 % TRPCN 4 5/8 03/01/34	750	0	0	750 USD	92.51%	693'796.50	0.04	a)
US89352HAW97	4.2500 % TRPCN 4 1/4 05/15/28	650	0	0	650 USD	96.29%	625'877.85	0.04	a)
US89352HAX70	4.7500 % TRPCN 4 3/4 05/15/38	250	250	0	500 USD	90.35%	451'765.00	0.03	a)
US89352HAY53	4.8750 % TRPCN 4 7/8 05/15/48	500	0	0	500 USD	87.91%	439'563.50	0.03	a)
US89352HAZ29	5.1000 % TRPCN 5.1 03/15/49	500	0	0	500 USD	91.67%	458'360.50	0.03	a)
US89352HBA68	4.1000 % TRPCN 4.1 04/15/30	300	0	0	300 USD	93.51%	280'520.40	0.02	a)
US89352HBE80	6.2030 % TRPCN 6.203 03/09/26	0	250	0	250 USD	100.00%	249'999.00	0.02	a)
US89356BAC28	5.3000 % TRPCN 5.3 03/15/2077	250	0	0	250 USD	92.94%	232'354.25	0.01	a)
US89356BAE83	5.5000 % TRPCN 5 1/2 09/15/2079	0	250	0	250 USD	89.25%	223'125.00	0.01	a)
US89356BAG32	5.6000 % TRPCN 5.6 03/07/2082	250	0	0	250 USD	87.75%	219'375.00	0.01	a)
US893574AH62	7.8500 % WMB 7.85 02/01/26	250	0	0	250 USD	104.23%	260'581.50	0.02	a)
US893574AR45	3.9500 % WMB 3.95 05/15/50	400	0	0	400 USD	77.88%	311'538.40	0.02	a)
US89417EAD13	6.2500 % TRV 6 1/4 06/15/37 MTN	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89417EAJ82	4.6000 % TRV 4.6 08/01/43	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89417EAN94	4.0500 % TRV 4.05 03/07/48	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89417EAP43	4.1000 % TRV 4.1 03/04/49	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89417EAS81	5.4500 % TRV 5.45 05/25/53	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89420GAE98	6.3750 % TRV 6 3/8 03/15/33	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US896239AC42	4.9000 % TRMB 4.9 06/15/28	500	0	0	500 USD	98.94%	494'691.50	0.03	a)
US896239AE08	6.1000 % TRMB 6.1 03/15/33	0	230	0	230 USD	104.57%	240'499.96	0.02	a)
US89641UAC53	4.4000 % WTW 4.4 03/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US89681LAA08	3.2500 % TRTN 3 1/4 03/15/32	400	0	0	400 USD	79.62%	318'465.20	0.02	a)
US902494AX19	3.9500 % TSN 3.95 08/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US902494AY91	5.1500 % TSN 5.15 08/15/44	350	0	0	350 USD	89.77%	314'178.55	0.02	a)
US902494AZ66	4.8750 % TSN 4 7/8 08/15/34	250	0	0	250 USD	95.00%	237'495.25	0.01	a)
US902494BC62	3.5500 % TSN 3.55 06/02/27	600	0	0	600 USD	94.72%	568'335.60	0.04	a)
US902494BD46	4.5500 % TSN 4.55 06/02/47	1'000	0	0	1'000 USD	81.02%	810'154.00	0.05	a)
US902494BH59	5.1000 % TSN 5.1 09/28/48	0	300	0	300 USD	87.97%	263'918.70	0.02	a)
US902613AX64	3.7500 % UBS 3 3/4 03/26/25	0	700	0	700 USD	98.01%	686'049.70	0.04	a)
US902613AY48	4.8750 % UBS 4 7/8 05/15/45	0	500	0	500 USD	92.43%	462'151.50	0.03	a)
US902613BB36	4.5500 % UBS 4.55 04/17/26	0	1'000	0	1'000 USD	98.24%	982'412.00	0.06	a)
US90265EAQ35	3.2000 % UDR 3.2 01/15/30 MTN	500	0	0	500 USD	89.60%	447'976.00	0.03	a)
US902674A263	4.5000 % UBS 4 1/2 06/26/48	0	200	0	200 USD	92.09%	184'175.20	0.01	a)
US902674ZV55	5.8000 % UBS 5.8 09/11/25	0	300	0	300 USD	100.77%	302'302.20	0.02	a)
US902674ZW39	5.6500 % UBS 5.65 09/11/28	0	400	0	400 USD	101.96%	407'850.40	0.03	a)
US904764AH00	5.9000 % UNANA 5.9 11/15/32	400	0	0	400 USD	106.46%	425'846.80	0.03	a)
US904764AS64	3.1000 % UNANA 3.1 07/30/25	300	0	0	300 USD	97.53%	292'600.50	0.02	a)
US904764AU11	2.0000 % UNANA 2 07/28/26	700	0	0	700 USD	93.69%	655'852.40	0.04	a)
US904764AY33	2.9000 % UNANA 2.9 05/05/27	450	0	0	450 USD	94.58%	425'593.35	0.03	a)
US904764BC04	3.5000 % UNANA 3 1/2 03/22/28	350	0	0	350 USD	95.53%	334'339.25	0.02	a)
US904764BH90	2.1250 % UNANA 2 1/8 09/06/29	500	0	0	500 USD	86.88%	434'411.50	0.03	a)
US904764BQ99	1.7500 % UNANA 1 3/4 08/12/31	0	250	0	250 USD	80.59%	201'470.00	0.01	a)
US904764BR72	2.6250 % UNANA 2 5/8 08/12/51 30Y	0	200	0	200 USD	64.52%	129'040.60	0.01	a)
US904764BT39	5.0000 % UNANA 5 12/08/33	0	200	0	200 USD	99.84%	199'680.80	0.01	a)
US906548CS94	2.6250 % AEE 2 5/8 03/15/51	500	0	0	500 USD	60.67%	303'329.50	0.02	a)
US906548CU41	3.9000 % AEE 3.9 04/01/52	0	150	0	150 USD	78.12%	117'175.20	0.01	a)
US906548CW07	5.4500 % AEE 5.45 03/15/53	0	150	0	150 USD	98.09%	147'132.30	0.01	a)
US907818EH70	2.7500 % UNP 2 3/4 03/01/26	500	0	0	500 USD	95.78%	478'912.00	0.03	a)
US907818EJ37	4.0500 % UNP 4.05 03/01/46	250	0	0	250 USD	82.14%	205'362.00	0.01	a)
US907818EM65	3.7990 % UNP 3.799 10/01/51	750	0	0	750 USD	79.24%	594'287.25	0.04	a)
US907818EP96	3.0000 % UNP 3 04/15/27	500	0	0	500 USD	94.82%	474'095.00	0.03	a)
US907818ER52	4.1000 % UNP 4.1 09/15/67	250	0	0	250 USD	79.33%	198'331.25	0.01	a)
US907818EY04	3.9500 % UNP 3.95 09/10/28	0	300	0	300 USD	97.22%	291'646.20	0.02	a)
US907818FE31	3.9500 % UNP 3.95 08/15/59	500	0	0	500 USD	77.25%	386'247.00	0.02	a)
US907818FG88	3.8390 % UNP 3.839 03/20/60	1'125	0	0	1'125 USD	76.11%	856'257.75	0.05	a)
US907818FL73	3.7500 % UNP 3 3/4 02/05/70	300	0	0	300 USD	73.02%	219'053.40	0.01	a)
US907818FN30	2.9730 % UNP 2.973 09/16/62	500	0	0	500 USD	62.25%	311'269.50	0.02	a)
US907818FS27	3.7990 % UNP 3.799 04/06/2071	500	0	0	500 USD	73.17%	365'853.00	0.02	a)
US907818FT00	3.2000 % UNP 3.2 05/20/41	500	0	0	500 USD	77.02%	385'112.00	0.02	a)
US907818FU72	2.3750 % UNP 2 3/8 05/20/31	500	0	0	500 USD	84.39%	421'973.00	0.03	a)
US907818FX12	2.8000 % UNP 2.8 02/14/32	750	0	0	750 USD	85.95%	644'611.50	0.04	a)
US907818FZ69	3.5000 % UNP 3 1/2 02/14/53	250	0	0	250 USD	74.09%	185'228.25	0.01	a)
US907818GA00	3.8500 % UNP 3.85 02/14/2072	200	0	0	200 USD	74.23%	148'468.80	0.01	a)
US907818GB82	4.5000 % UNP 4 1/2 01/20/33	0	250	0	250 USD	96.67%	241'687.25	0.02	a)
US907818GC65	4.9500 % UNP 4.95 09/09/52	0	250	0	250 USD	96.12%	240'296.00	0.02	a)
US907818GE22	4.7500 % UNP 4 3/4 02/21/26	0	200	0	200 USD	99.62%	199'232.40	0.01	a)
US907818GF96	4.9500 % UNP 4.95 05/15/53	0	150	0	150 USD	95.04%	142'566.30	0.01	a)
US90931GAA76	5.8750 % UAL 5 7/8 10/15/27 201	1'000	0	0	1'000 USD	100.63%	602'739.56	0.04	a)
US90932LAJ61	5.8000 % UAL 5.8 01/15/36	0	400	0	400 USD	101.08%	404'336.00	0.03	a)
US91127KAF93	3.0590 % UOBSP 3.059 04/07/25 144A	500	0	0	500 USD	97.81%	489'034.00	0.03	a)
US91127KAH59	3.8630 % UOBSP 3.863 10/07/32 144A	500	0	0	500 USD	95.05%	475'263.00	0.03	a)
US911312AJ59	6.2000 % UPS 6.2 01/15/38	790	500	0	1'290 USD	109.49%	1'412'460.99	0.09	a)
US911312AN61	4.8750 % UPS 4 7/8 11/15/40	300	0	0	300 USD	95.32%	285'950.40	0.02	a)
US911312BM79	3.0500 % UPS 3.05 11/15/27	500	0	0	500 USD	93.93%	469'662.50	0.03	a)
US911312BV78	5.2000 % UPS 5.2 04/01/40	500	0	0	500 USD	99.02%	495'113.50	0.03	a)
US911312BW51	5.3000 % UPS 5.3 04/01/50	500	0	0	500 USD	99.76%	498'798.00	0.03	a)
US911312BX35	3.9000 % UPS 3.9 04/01/25	0	300	0	300 USD	98.62%	295'849.50	0.02	a)
US911312BZ82	4.8750 % UPS 4 7/8 03/03/33	0	250	0	250 USD	99.37%	248'435.75	0.02	a)
US911312CA23	5.0500 % UPS 5.05 03/03/53	0	500	0	500 USD	96.69%	483'443.00	0.03	a)
US911365BM59	3.8750 % URI 3 7/8 11/15/27	300	0	0	300 USD	94.02%	282'048.90	0.02	a)
US91159HHM51	3.1000 % USB 3.1 04/27/26 MTN	0	500	0	500 USD	95.54%	477'693.50	0.03	a)
US91159HHN35	2.3750 % USB 2 3/8 07/22/26 V	0	150	0	150 USD	93.79%	140'685.75	0.01	a)
US91159HHR49	3.1500 % USB 3.15 04/27/27 X	0	500	0	500 USD	94.05%	470'233.00	0.03	a)
US91159HHS22	3.9000 % USB 3.9 04/26/28 MTN	0	300	0	300 USD	95.65%	286'943.40	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 USD	in % 7)	Kat.
US91159HHZ64	1.4500 % USB 1.45 05/12/25	0	500	0	500 USD	95.76%	478'798.50	0.03	a)
US91159HJA95	1.3750 % USB 1 3/8 07/22/30 MTN	0	500	0	500 USD	78.83%	394'136.50	0.02	a)
US91159HJC51	2.2150 % USB 2.215 01/27/28 MTN	0	300	0	300 USD	91.68%	275'054.70	0.02	a)
US91159HJD35	2.6770 % USB 2.677 01/27/33 MTN	0	500	0	500 USD	81.88%	409'384.50	0.03	a)
US91159HJF82	4.5480 % USB 4.548 07/22/28 MTN	0	500	0	500 USD	97.66%	488'302.50	0.03	a)
US91159HJG65	4.9670 % USB 4.967 07/22/33 MTN	0	300	0	300 USD	93.50%	280'500.60	0.02	a)
US91159HJH49	5.7270 % USB 5.727 10/21/26	0	500	0	500 USD	100.43%	502'132.50	0.03	a)
US91159HJJ05	5.8500 % USB 5.85 10/21/33	0	200	0	200 USD	100.98%	201'955.60	0.01	a)
US91159HJK77	4.6530 % USB 4.653 02/01/29	0	500	0	500 USD	97.26%	486'277.50	0.03	a)
US91159HJL50	4.8390 % USB 4.839 02/01/34	0	750	0	750 USD	93.97%	704'739.75	0.04	a)
US91159HJM34	5.7750 % USB 5.775 06/12/29	0	500	0	500 USD	101.18%	505'887.00	0.03	a)
US91159HJN17	5.8360 % USB 5.836 06/12/34	0	600	0	600 USD	100.79%	604'749.60	0.04	a)
US91159HJP64	6.7870 % USB 6.787 10/26/27	0	500	0	500 USD	102.80%	514'002.00	0.03	a)
US91159HJQ48	5.3840 % USB 5.384 01/23/30	0	400	0	400 USD	99.37%	397'484.80	0.02	a)
US91159HJR21	5.6780 % USB 5.678 01/23/35	0	500	0	500 USD	99.71%	498'573.00	0.03	a)
US91324PAR38	5.8000 % UNH 5.8 03/15/36	100	200	0	300 USD	105.89%	317'669.40	0.02	a)
US91324PAX06	6.5000 % UNH 6 1/2 06/15/37	0	150	0	150 USD	111.31%	166'959.30	0.01	a)
US91324PBE16	6.6250 % UNH 6 5/8 11/15/37	150	200	0	350 USD	113.20%	396'193.35	0.02	a)
US91324PBK75	6.8750 % UNH 6 7/8 02/15/38	250	0	0	250 USD	116.07%	290'181.25	0.02	a)
US91324PCA84	3.9500 % UNH 3.95 10/15/42	600	0	0	600 USD	83.88%	503'266.80	0.03	a)
US91324PCD24	4.2500 % UNH 4 1/4 03/15/43	150	0	0	150 USD	87.06%	130'592.25	0.01	a)
US91324PCP53	3.7500 % UNH 3 3/4 07/15/25	500	500	0	1'000 USD	98.14%	981'425.00	0.06	a)
US91324PCQ37	4.6250 % UNH 4 5/8 07/15/35	500	0	0	500 USD	96.32%	481'589.00	0.03	a)
US91324PCR10	4.7500 % UNH 4 3/4 07/15/45	750	0	0	750 USD	92.65%	694'843.50	0.04	a)
US91324PCV22	3.1000 % UNH 3.1 03/15/26	400	0	0	400 USD	96.56%	386'251.20	0.02	a)
US91324PCX87	4.2000 % UNH 4.2 01/15/47	250	0	0	250 USD	84.50%	211'253.25	0.01	a)
US91324PCY60	3.3750 % UNH 3 3/8 04/15/27	500	0	0	500 USD	95.98%	479'916.50	0.03	a)
US91324PCZ36	4.2500 % UNH 4 1/4 04/15/47	500	0	0	500 USD	85.07%	425'329.50	0.03	a)
US91324PDE97	2.9500 % UNH 2.95 10/15/27	500	0	0	500 USD	93.85%	469'237.50	0.03	a)
US91324PDF62	3.7500 % UNH 3 3/4 10/15/47	500	0	0	500 USD	77.93%	389'658.50	0.02	a)
US91324PDK57	3.8500 % UNH 3.85 06/15/28	500	0	0	500 USD	96.25%	481'269.50	0.03	a)
US91324PDL31	4.2500 % UNH 4 1/4 06/15/48	500	0	0	500 USD	84.78%	423'896.00	0.03	a)
US91324PDP45	3.8750 % UNH 3 7/8 12/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	95.86%	958'619.00	0.06	a)
US91324PDQ28	4.4500 % UNH 4.45 12/15/48	250	0	0	250 USD	87.93%	219'827.25	0.01	a)
US91324PDT66	3.5000 % UNH 3 1/2 08/15/39	0	200	0	200 USD	80.95%	161'897.80	0.01	a)
US91324PDU30	3.7000 % UNH 3.7 08/15/49	500	0	0	500 USD	77.09%	385'469.00	0.02	a)
US91324PDV13	3.8750 % UNH 3 7/8 08/15/59	500	0	0	500 USD	76.67%	383'368.50	0.02	a)
US91324PDX78	2.0000 % UNH 2 05/15/30	500	0	0	500 USD	84.13%	420'662.50	0.03	a)
US91324PDY51	2.7500 % UNH 2 3/4 05/15/40	0	400	0	400 USD	71.83%	287'313.20	0.02	a)
US91324PDZ27	2.9000 % UNH 2.9 05/15/50	500	0	0	500 USD	66.93%	334'659.50	0.02	a)
US91324PEC23	1.1500 % UNH 1.15 05/15/26	0	100	0	100 USD	92.20%	92'197.00	0.01	a)
US91324PEE88	3.0500 % UNH 3.05 05/15/41	0	280	0	280 USD	74.44%	208'444.88	0.01	a)
US91324PEF53	3.2500 % UNH 3 1/4 05/15/51	0	490	0	490 USD	69.97%	342'837.32	0.02	a)
US91324PEG37	3.7000 % UNH 3.7 05/15/27	250	0	0	250 USD	96.72%	241'806.75	0.02	a)
US91324PEJ75	4.2000 % UNH 4.2 05/15/32	500	0	0	500 USD	94.58%	472'877.00	0.03	a)
US91324PEK49	4.7500 % UNH 4 3/4 05/15/52	700	0	0	700 USD	91.03%	637'196.70	0.04	a)
US91324PEL22	4.9500 % UNH 4.95 05/15/62	0	200	0	200 USD	92.46%	184'928.80	0.01	a)
US91324PEN87	5.1500 % UNH 5.15 10/15/25	300	0	0	300 USD	100.17%	300'511.80	0.02	a)
US91324PEQ19	5.3000 % UNH 5.3 02/15/30	300	0	0	300 USD	102.06%	306'167.10	0.02	a)
US91324PER91	5.3500 % UNH 5.35 02/15/33	500	0	0	500 USD	102.26%	511'310.00	0.03	a)
US91324PES74	5.8750 % UNH 5 7/8 02/15/53	400	150	0	550 USD	107.45%	590'990.95	0.04	a)
US91324PET57	6.0500 % UNH 6.05 02/15/63	0	500	0	500 USD	108.95%	544'732.50	0.03	a)
US91324PEU21	4.2500 % UNH 4 1/4 01/15/29	0	300	0	300 USD	97.39%	292'171.80	0.02	a)
US91324PEV04	4.5000 % UNH 4 1/2 04/15/33	0	450	0	450 USD	96.22%	432'998.10	0.03	a)
US91324PEW86	5.0500 % UNH 5.05 04/15/53	0	600	0	600 USD	95.70%	574'187.40	0.04	a)
US91324PEX69	5.2000 % UNH 5.2 04/15/63	0	500	0	500 USD	95.64%	478'222.00	0.03	a)
US914453AA36	4.0630 % UNV MIA 4.063 04/01/52 2022	0	150	0	150 USD	84.23%	126'338.10	0.01	a)
US914886AH93	4.9760 % USCTRJ 4.976 10/01/53	0	140	0	140 USD	100.27%	140'380.24	0.01	a)
US91529YAJ55	5.7500 % UNM 5 3/4 08/15/42	0	150	0	150 USD	96.59%	144'885.15	0.01	a)
US91529YAR71	4.1250 % UNM 4 1/8 06/15/51	0	250	0	250 USD	73.79%	184'485.25	0.01	a)
US918204BB37	2.8000 % VFC 2.8 04/23/27	400	0	0	400 USD	90.48%	361'910.40	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 USD	in % 7)	Kat.
US918204BC10	2.9500 % VFC 2.95 04/23/30	0	220	0	220 USD	82.14%	180'700.52	0.01	a)
US91913YAE05	7.5000 % VLO 7 1/2 04/15/32	300	0	0	300 USD	113.44%	340'309.50	0.02	a)
US91913YAL48	6.6250 % VLO 6 5/8 06/15/37	0	400	0	400 USD	106.89%	427'573.20	0.03	a)
US91913YBB56	2.1500 % VLO 2.15 09/15/27	0	150	0	150 USD	90.60%	135'903.00	0.01	a)
US91913YBD13	3.6500 % VLO 3.65 12/01/51	0	250	0	250 USD	70.39%	175'972.50	0.01	a)
US91913YBE95	4.0000 % VLO 4 06/01/52	500	0	0	500 USD	74.86%	374'285.50	0.02	a)
US91914JAB89	4.5000 % VLO 4 1/2 03/15/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92277GAE70	3.5000 % VTR 3 1/2 02/01/25	250	0	0	250 USD	98.01%	245'017.75	0.02	a)
US92277GAM96	4.0000 % VTR 4 03/01/28	200	0	0	200 USD	95.06%	190'117.20	0.01	a)
US92277GAN79	4.4000 % VTR 4.4 01/15/29	500	0	0	500 USD	95.86%	479'293.00	0.03	a)
US92338CAA18	5.5000 % VLTO 5 1/2 09/18/26 144A	0	200	0	200 USD	100.34%	200'675.00	0.01	a)
US92338CAC73	5.3500 % VLTO 5.35 09/18/28 144A	0	200	0	200 USD	100.69%	201'383.20	0.01	a)
US92338CAE30	5.4500 % VLTO 5.45 09/18/33 144A	0	200	0	200 USD	100.26%	200'521.80	0.01	a)
US92343EAL65	4.7500 % VRSN 4 3/4 07/15/27	0	200	0	200 USD	97.75%	195'500.00	0.01	a)
US92343EAM49	2.7000 % VRSN 2.7 06/15/31	0	200	0	200 USD	82.88%	165'750.00	0.01	a)
US92343VBG86	3.8500 % VZ 3.85 11/01/42	200	0	0	200 USD	80.21%	160'412.80	0.01	a)
US92343VCK89	4.8620 % VZ 4.862 08/21/46	500	0	0	500 USD	92.14%	460'702.50	0.03	a)
US92343VCM46	5.0120 % VZ 5.012 08/21/54	0	200	0	200 USD	92.81%	185'627.80	0.01	a)
US92343VCQ59	4.4000 % VZ 4.4 11/01/34	400	0	0	400 USD	93.26%	373'044.00	0.02	a)
US92343VCR33	3.5000 % VZ 3 1/2 11/01/24	2'000	0	0	2'000 USD	98.61%	1'972'280.00	0.12	a)
US92343VCV45	4.2720 % VZ 4.272 01/15/36	900	0	0	900 USD	90.50%	814'509.90	0.05	a)
US92343VCX01	4.5220 % VZ 4.522 09/15/48	1'250	0	0	1'250 USD	87.69%	1'096'145.00	0.07	a)
US92343VCZ58	4.6720 % VZ 4.672 03/15/55	0	200	0	200 USD	88.27%	176'537.20	0.01	a)
US92343VDC54	4.1250 % VZ 4 1/8 08/15/46	800	0	0	800 USD	82.28%	658'264.00	0.04	a)
US92343VDD38	2.6250 % VZ 2 5/8 08/15/26	1'350	0	0	1'350 USD	94.31%	1'273'158.00	0.08	a)
US92343VDR24	4.8120 % VZ 4.812 03/15/39	1'000	100	0	1'100 USD	93.76%	1'031'393.00	0.06	a)
US92343VDU52	5.2500 % VZ 5 1/4 03/16/37	500	0	0	500 USD	100.07%	500'325.00	0.03	a)
US92343VDY74	4.1250 % VZ 4 1/8 03/16/27	1'000	0	0	1'000 USD	97.32%	973'195.00	0.06	a)
US92343VEA89	4.5000 % VZ 4 1/2 08/10/33	500	0	0	500 USD	94.41%	472'060.50	0.03	a)
US92343VEN01	3.3760 % VZ 3.376 02/15/25	250	0	0	250 USD	98.10%	245'237.75	0.02	a)
US92343VER15	4.3290 % VZ 4.329 09/21/28	1'300	0	0	1'300 USD	96.98%	1'260'723.10	0.08	a)
US92343VEU44	4.0160 % VZ 4.016 12/03/29	1'701	0	0	1'701 USD	94.92%	1'614'534.77	0.10	a)
US92343VFR06	1.7500 % VZ 1 3/4 01/20/31	1'500	0	0	1'500 USD	79.90%	1'198'486.50	0.07	a)
US92343VFS88	0.8500 % VZ 0.85 11/20/25	500	0	0	500 USD	92.80%	464'013.00	0.03	a)
US92343VFT61	2.6500 % VZ 2.65 11/20/40	0	100	0	100 USD	68.87%	68'873.70	0.00	a)
US92343VFU35	2.8750 % VZ 2 7/8 11/20/50	1'000	0	0	1'000 USD	64.23%	642'321.00	0.04	a)
US92343VFW18	3.0000 % VZ 3 11/20/60	500	0	0	500 USD	60.54%	302'705.00	0.02	a)
US92343VFW90	2.9870 % VZ 2.987 10/30/56	1'769	0	0	1'769 USD	62.82%	1'111'262.80	0.07	a)
US92343VGB45	3.5500 % VZ 3.55 03/22/51	1'500	250	0	1'750 USD	72.92%	1'276'173.50	0.08	a)
US92343VGC28	3.7000 % VZ 3.7 03/22/61	1'000	0	0	1'000 USD	69.97%	699'729.00	0.04	a)
US92343VGG32	1.4500 % VZ 1.45 03/20/26	0	550	0	550 USD	92.73%	510'015.55	0.03	a)
US92343VGH15	2.1000 % VZ 2.1 03/22/28	500	0	0	500 USD	89.22%	446'110.50	0.03	a)
US92343VGJ70	2.5500 % VZ 2.55 03/21/31	500	400	0	900 USD	84.49%	760'385.70	0.05	a)
US92343VGK44	3.4000 % VZ 3.4 03/22/41	500	0	0	500 USD	77.00%	384'986.50	0.02	a)
US92343VGN82	2.3550 % VZ 2.355 03/15/32	1'226	0	0	1'226 USD	80.98%	992'822.16	0.06	a)
US92343VGT52	5.0500 % VZ 5.05 05/09/33	0	300	0	300 USD	99.19%	297'576.60	0.02	a)
US92345YAD85	4.0000 % VRSK 4 06/15/25	300	0	0	300 USD	98.24%	294'720.60	0.02	a)
US92345YAF34	4.1250 % VRSK 4 1/8 03/15/29	0	150	0	150 USD	95.82%	143'728.80	0.01	a)
US92345YAG17	3.6250 % VRSK 3 5/8 05/15/50	0	250	0	250 USD	72.99%	182'477.50	0.01	a)
US92345YAH99	5.7500 % VRSK 5 3/4 04/01/33	0	150	0	150 USD	103.12%	154'681.65	0.01	a)
US925524AH30	7.8750 % PARA 7 7/8 07/30/30	500	0	0	500 USD	101.81%	509'046.00	0.03	a)
US925524AX89	6.8750 % PARA 6 7/8 04/30/36	500	0	0	500 USD	91.48%	457'423.00	0.03	a)
US92553PAP71	4.3750 % PARA 4 3/8 03/15/43	184	300	0	484 USD	66.90%	323'773.74	0.02	a)
US92553PAU66	5.8500 % PARA 5.85 09/01/43	350	0	0	350 USD	80.90%	283'147.90	0.02	a)
US92556HAC16	4.9500 % PARA 4.95 05/19/50	0	200	0	200 USD	71.16%	142'326.60	0.01	a)
US92556HAD98	4.2000 % PARA 4.2 05/19/32	500	0	0	500 USD	81.16%	405'809.00	0.03	a)
US92556HAE71	6.3750 % PARA 6 3/8 03/30/62	0	290	290	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAD82	2.7000 % VTRS 2.7 06/22/30	0	424	424	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAE65	3.8500 % VTRS 3.85 06/22/40	0	430	430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92556VAF31	4.0000 % VTRS 4 06/22/50	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US925650AA17	4.3750 % VICI 4 3/8 05/15/25	0	100	0	100 USD	98.13%	98'125.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US925650AB99	4.7500 % VICI 4 3/4 02/15/28	0	400	0	400 USD	96.75%	387'000.00	0.02	a)
US925650AC72	4.9500 % VICI 4.95 02/15/30	0	300	0	300 USD	95.25%	285'750.00	0.02	a)
US925650AD55	5.1250 % VICI 5 1/8 05/15/32	0	465	0	465 USD	93.88%	436'518.75	0.03	a)
US925650AE39	5.6250 % VICI 5 5/8 05/15/52	0	250	0	250 USD	89.75%	224'375.00	0.01	a)
US927804FG41	8.8750 % D 8 7/8 11/15/38	500	0	0	500 USD	132.67%	663'363.00	0.04	a)
US927804FL36	4.0000 % D 4 01/15/43	250	0	0	250 USD	82.40%	206'001.75	0.01	a)
US927804FR06	4.4500 % D 4.45 02/15/44	350	0	0	350 USD	85.98%	300'922.65	0.02	a)
US927804FU35	3.1500 % D 3.15 01/15/26 A	500	0	0	500 USD	96.42%	482'103.00	0.03	a)
US927804FW90	4.0000 % D 4 11/15/46 C	200	0	0	200 USD	79.56%	159'117.80	0.01	a)
US927804GD01	2.4500 % D 2.45 12/15/50	500	0	0	500 USD	57.94%	289'716.50	0.02	a)
US927804GF58	2.9500 % D 2.95 11/15/51	250	0	0	250 USD	63.77%	159'423.50	0.01	a)
US927804GH15	3.7500 % D 3 3/4 05/15/27 B	200	0	0	200 USD	96.06%	192'116.80	0.01	a)
US927804GN82	5.7000 % D 5.7 08/15/53	0	500	0	500 USD	101.17%	505'857.00	0.03	a)
US92826CAD48	3.1500 % V 3.15 12/14/25	1'050	0	0	1'050 USD	96.92%	1'017'631.65	0.06	a)
US92826CAE21	4.1500 % V 4.15 12/14/35	600	0	0	600 USD	93.60%	561'601.20	0.04	a)
US92826CAF95	4.3000 % V 4.3 12/14/45	500	0	0	500 USD	89.50%	447'510.00	0.03	a)
US92826CAJ18	3.6500 % V 3.65 09/15/47	750	0	0	750 USD	79.83%	598'689.00	0.04	a)
US92826CAL63	1.9000 % V 1.9 04/15/27	1'100	0	0	1'100 USD	92.17%	1'013'900.80	0.06	a)
US92826CAM47	2.0500 % V 2.05 04/15/30	600	0	0	600 USD	85.69%	514'155.60	0.03	a)
US92826CAN20	1.1000 % V 1.1 02/15/31	500	0	0	500 USD	78.79%	393'925.50	0.02	a)
US92826CAP77	0.7500 % V 0 3/4 08/15/27	2'000	225	0	2'225 USD	87.80%	1'953'561.13	0.12	a)
US92826CAQ50	2.0000 % V 2 08/15/50	500	0	0	500 USD	58.07%	290'332.50	0.02	a)
US928563AC98	3.9000 % VMW 3.9 08/21/27	500	0	0	500 USD	95.33%	476'629.00	0.03	a)
US928563AD71	4.5000 % VMW 4 1/2 05/15/25	500	0	0	500 USD	98.65%	493'235.50	0.03	a)
US928563AH85	1.0000 % VMW 1 08/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US928563AJ42	1.4000 % VMW 1.4 08/15/26	1'000	0	0	1'000 USD	90.77%	907'749.00	0.06	a)
US928563AL97	2.2000 % VMW 2.2 08/15/31	1'400	0	0	1'400 USD	80.70%	1'129'850.40	0.07	a)
US92857WAQ33	6.1500 % VOD 6.15 02/27/37	610	0	0	610 USD	104.82%	639'415.42	0.04	a)
US92857WBD11	4.3750 % VOD 4 3/8 02/19/43	350	0	0	350 USD	84.41%	295'433.95	0.02	a)
US92857WBJ80	4.1250 % VOD 4 1/8 05/30/25	500	0	0	500 USD	98.48%	492'409.50	0.03	a)
US92857WBK53	4.3750 % VOD 4 3/8 05/30/28	1'050	0	0	1'050 USD	98.08%	1'029'836.85	0.06	a)
US92857WBL37	5.0000 % VOD 5 05/30/38	0	200	0	200 USD	96.60%	193'190.80	0.01	a)
US92857WBM10	5.2500 % VOD 5 1/4 05/30/48	1'300	0	0	1'300 USD	93.00%	1'208'977.90	0.08	a)
US92857WBU36	4.2500 % VOD 4 1/4 09/17/50	1'000	0	0	1'000 USD	78.58%	785'768.00	0.05	a)
US92857WBY57	5.6250 % VOD 5 5/8 02/10/53	0	300	0	300 USD	96.75%	290'250.00	0.02	a)
US928881AF82	2.9500 % VNT 2.95 04/01/31	0	150	0	150 USD	81.87%	122'809.95	0.01	a)
US929160AV17	4.5000 % VMC 4 1/2 06/15/47	0	220	0	220 USD	86.25%	189'750.44	0.01	a)
US929160AZ21	3.5000 % VMC 3 1/2 06/01/30	0	235	0	235 USD	90.98%	213'806.29	0.01	a)
US929160BA60	5.8000 % VMC 5.8 03/01/26	0	170	0	170 USD	100.01%	170'022.10	0.01	a)
US92936MAF41	3.7500 % WPLN 3 3/4 09/19/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92936UAG40	2.4000 % WPC 2.4 02/01/31	0	150	0	150 USD	82.39%	123'588.60	0.01	a)
US92940PAF18	4.2000 % WRK 4.2 06/01/32	200	0	0	200 USD	93.72%	187'431.20	0.01	a)
US92940PAG90	3.0000 % WRK 3 06/15/33	500	0	0	500 USD	84.40%	422'023.50	0.03	a)
US92976GAG64	5.8500 % WFC 5.85 02/01/37 BKNT	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US929903AM44	5.5000 % WFC 5 1/2 08/01/35	270	0	270	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142DP52	3.3000 % WMT 3.3 04/22/24	1'050	0	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931142EB57	3.9500 % WMT 3.95 06/28/38	500	0	0	500 USD	90.25%	451'238.00	0.03	a)
US931142EC31	4.0500 % WMT 4.05 06/29/48	1'000	0	0	1'000 USD	86.22%	862'153.00	0.05	a)
US931142ED14	3.5500 % WMT 3.55 06/26/25	500	0	0	500 USD	98.24%	491'197.00	0.03	a)
US931142EE96	3.7000 % WMT 3.7 06/26/28	1'000	0	0	1'000 USD	96.80%	967'962.00	0.06	a)
US931142EN95	3.2500 % WMT 3 1/4 07/08/29	500	0	0	500 USD	94.07%	470'349.00	0.03	a)
US931142EP44	2.9500 % WMT 2.95 09/24/49	500	0	0	500 USD	69.90%	349'521.00	0.02	a)
US931142ET65	1.8000 % WMT 1.8 09/22/31	1'000	0	0	1'000 USD	82.00%	819'998.00	0.05	a)
US931142EU39	2.5000 % WMT 2 1/2 09/22/41	500	0	0	500 USD	70.68%	353'422.00	0.02	a)
US931142EV12	2.6500 % WMT 2.65 09/22/51	500	0	0	500 USD	65.03%	325'145.50	0.02	a)
US931142EX77	3.9500 % WMT 3.95 09/09/27	0	300	0	300 USD	97.92%	293'773.80	0.02	a)
US931142EZ26	4.5000 % WMT 4 1/2 09/09/52	0	250	0	250 USD	90.74%	226'854.75	0.01	a)
US931142FA65	4.0000 % WMT 4 04/15/26	0	500	0	500 USD	98.43%	492'125.00	0.03	a)
US931142FB49	3.9000 % WMT 3.9 04/15/28	0	500	0	500 USD	97.60%	487'995.00	0.03	a)
US931142FC22	4.0000 % WMT 4 04/15/30	0	200	0	200 USD	96.74%	193'487.40	0.01	a)
US931142FD05	4.1000 % WMT 4.1 04/15/33	0	900	0	900 USD	95.01%	855'105.30	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 USD	in % 7)	Kat.
US931142FE87	4.5000 % WMT 4 1/2 04/15/53	0	400	0	400 USD	90.71%	362'851.60	0.02	a)
US931427AC23	4.8000 % WBA 4.8 11/18/44	0	250	0	250 USD	83.18%	207'955.00	0.01	a)
US931427AH10	3.8000 % WBA 3.8 11/18/24	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US931427AQ19	3.4500 % WBA 3.45 06/01/26	600	0	0	600 USD	95.09%	570'550.80	0.04	a)
US931427AS74	3.2000 % WBA 3.2 04/15/30	0	150	0	150 USD	86.22%	129'327.15	0.01	a)
US931427AT57	4.1000 % WBA 4.1 04/15/50	0	150	0	150 USD	72.94%	109'403.25	0.01	a)
US940663AC19	3.5240 % WAUNIV 3.524 04/15/54 2022	0	146	0	146 USD	77.27%	112'810.26	0.01	a)
US94106BAA98	2.6000 % WCNCN 2.6 02/01/30	1'000	0	0	1'000 USD	87.68%	876'795.00	0.05	a)
US94106BAD38	2.9500 % WCNCN 2.95 01/15/52	0	300	0	300 USD	66.09%	198'266.10	0.01	a)
US94106BAF85	4.2000 % WCNCN 4.2 01/15/33	0	200	0	200 USD	93.35%	186'697.60	0.01	a)
US94106LBM00	2.5000 % WM 2 1/2 11/15/50	0	300	0	300 USD	61.85%	185'550.00	0.01	a)
US94106LBN82	1.1500 % WM 1.15 03/15/28	0	250	0	250 USD	86.47%	216'175.25	0.01	a)
US94106LBP31	1.5000 % WM 1 1/2 03/15/31	500	0	0	500 USD	79.36%	396'815.50	0.02	a)
US94106LBS79	4.1500 % WM 4.15 04/15/32	0	250	0	250 USD	94.01%	235'014.75	0.01	a)
US94106LBT52	4.6250 % WM 4 5/8 02/15/30	0	300	0	300 USD	98.31%	294'933.90	0.02	a)
US94106LBU26	4.6250 % WM 4 5/8 02/15/33	0	300	0	300 USD	96.53%	289'596.00	0.02	a)
US94106LBV09	4.8750 % WM 4 7/8 02/15/29	0	200	0	200 USD	100.08%	200'153.40	0.01	a)
US94106LBW81	4.8750 % WM 4 7/8 02/15/34	0	300	0	300 USD	98.07%	294'218.10	0.02	a)
US948596AE12	3.3750 % WB 3 3/8 07/08/30	0	600	0	600 USD	85.77%	514'600.20	0.03	a)
US94973VAY39	4.6250 % ELV 4 5/8 05/15/42	500	0	0	500 USD	88.90%	444'522.50	0.03	a)
US94973VBB27	4.6500 % ELV 4.65 01/15/43	180	0	0	180 USD	90.41%	162'739.08	0.01	a)
US94973VBF31	5.1000 % ELV 5.1 01/15/44	300	0	0	300 USD	94.28%	282'843.30	0.02	a)
US94973VBK26	4.6500 % ELV 4.65 08/15/44	500	0	0	500 USD	89.49%	447'453.00	0.03	a)
US949746RF01	5.6060 % WFC 5.606 01/15/44	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949746RW34	3.0000 % WFC 3 04/22/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949746SH57	3.0000 % WFC 3 10/23/26	1'950	0	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748FP04	5.3750 % WFC 5 3/8 11/02/43	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748FY11	4.1000 % WFC 4.1 06/03/26 MTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GA26	3.3000 % WFC 3.3 09/09/24 MTN	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GH78	3.0000 % WFC 3 02/19/25 MTN	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GK08	3.9000 % WFC 3.9 05/01/45	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GL80	4.3000 % WFC 4.3 07/22/27 GMTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GP94	3.5500 % WFC 3.55 09/29/25 MTN	85	0	85	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GQ77	4.9000 % WFC 4.9 11/17/45 GMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GT17	4.4000 % WFC 4.4 06/14/46 MTN	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US949748GU89	4.7500 % WFC 4 3/4 12/07/46 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2A01	3.5840 % WFC 3.584 05/22/28 MTN	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2C66	3.7500 % WFC 3 3/4 01/24/24 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2D40	4.1500 % WFC 4.15 01/24/29 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2G70	2.8790 % WFC 2.879 10/30/30 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2H53	2.4060 % WFC 2.406 10/30/25 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2J10	2.5720 % WFC 2.572 02/11/31 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2K82	2.1640 % WFC 2.164 02/11/26 MTN	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2L65	4.4780 % WFC 4.478 04/04/31 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2M49	5.0130 % WFC 5.013 04/04/51 MTN	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2N22	2.1880 % WFC 2.188 04/30/26	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2Q52	3.0680 % WFC 3.068 04/30/41	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2S19	2.3930 % WFC 2.393 06/02/28 MTN	250	250	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2U64	3.3500 % WFC 3.35 03/02/33 MTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2V48	3.5260 % WFC 3.526 03/24/28 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2X04	3.9080 % WFC 3.908 04/25/26 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U2Z51	4.6110 % WFC 4.611 04/25/53 MTN	1'000	200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3A91	4.8080 % WFC 4.808 07/25/28 MTN	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3B74	4.8970 % WFC 4.897 07/25/33 MTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3D31	5.3890 % WFC 5.389 04/24/34	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3E14	5.5740 % WFC 5.574 07/25/29 MTN	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3F88	5.5570 % WFC 5.557 07/25/34 MTN	0	1'200	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3G61	6.3030 % WFC 6.303 10/23/29	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95000U3H45	6.4910 % WFC 6.491 10/23/34	0	950	950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95040QAC87	4.2500 % WELL 4 1/4 04/01/26	250	0	0	250 USD	98.04%	245'090.75	0.02	a)
US95040QAD60	4.2500 % WELL 4 1/4 04/15/28	500	0	0	500 USD	96.58%	482'918.50	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 USD	in % 7)	Kat.
US95040QAF19	4.9500 % WELL 4.95 09/01/48	0	350	0	350 USD	90.69%	317'419.20	0.02	a)
US95040QAG91	3.6250 % WELL 3 5/8 03/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US95040QAJ31	3.1000 % WELL 3.1 01/15/30	1'000	0	0	1'000 USD	89.24%	892'368.00	0.06	a)
US95040QAP90	2.7500 % WELL 2 3/4 01/15/32	0	150	0	150 USD	83.25%	124'872.00	0.01	a)
US95040QAR56	3.8500 % WELL 3.85 06/15/32	300	0	0	300 USD	89.83%	269'487.30	0.02	a)
US958102AM75	4.7500 % WDC 4 3/4 02/15/26	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US958102AR62	3.1000 % WDC 3.1 02/01/32	500	0	0	500 USD	78.48%	392'388.00	0.02	a)
US958667AA50	5.2500 % WES 5 1/4 02/01/50	500	0	0	500 USD	88.50%	442'500.00	0.03	a)
US958667AB34	3.1000 % WES 3.1 02/01/25	300	0	0	300 USD	97.42%	292'260.00	0.02	a)
US958667AC17	4.0500 % WES 4.05 02/01/30	500	0	0	500 USD	92.50%	462'500.00	0.03	a)
US958667AE72	6.1500 % WES 6.15 04/01/33	0	150	0	150 USD	101.38%	152'062.50	0.01	a)
US959802AY56	2.8500 % WU 2.85 01/10/25	400	0	0	400 USD	97.56%	390'236.00	0.02	a)
US960386AM29	4.7000 % WAB 4.7 09/15/28	500	0	0	500 USD	97.69%	488'453.50	0.03	a)
US960386AN02	4.1500 % WAB 4.15 03/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US960386AQ33	3.2000 % WAB 3.2 06/15/25	1'000	0	0	1'000 USD	96.99%	969'860.00	0.06	a)
US960413AS12	5.0000 % WLK 5 08/15/46	0	200	0	200 USD	88.07%	176'145.00	0.01	a)
US960413AT94	3.6000 % WLK 3.6 08/15/26	0	220	0	220 USD	96.26%	211'764.96	0.01	a)
US960413AZ54	3.1250 % WLK 3 1/8 08/15/51	0	170	0	170 USD	62.58%	106'383.62	0.01	a)
US961214CX95	2.8500 % WSTP 2.85 05/13/26	750	0	0	750 USD	95.24%	714'278.25	0.04	a)
US961214DC40	2.7000 % WSTP 2.7 08/19/26	650	0	0	650 USD	94.86%	616'575.05	0.04	a)
US961214DF70	4.3220 % WSTP 4.322 11/23/31 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	95.61%	956'119.00	0.06	a)
US961214DK65	3.3500 % WSTP 3.35 03/08/27	750	0	0	750 USD	95.60%	717'006.00	0.04	a)
US961214EC31	3.3000 % WSTP 3.3 02/26/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US961214EF61	4.1100 % WSTP 4.11 07/24/34	500	0	0	500 USD	91.35%	456'751.50	0.03	a)
US961214EG45	4.4210 % WSTP 4.421 07/24/39	500	0	0	500 USD	86.67%	433'351.50	0.03	a)
US961214EH28	2.3500 % WSTP 2.35 02/19/25	1'000	0	0	1'000 USD	97.25%	972'478.00	0.06	a)
US961214EM13	2.8940 % WSTP 2.894 02/04/30	1'000	0	0	1'000 USD	97.01%	970'130.00	0.06	a)
US961214EP44	2.6680 % WSTP 2.668 11/15/35	0	300	0	300 USD	81.49%	244'477.80	0.02	a)
US961214EQ27	2.9630 % WSTP 2.963 11/16/40	0	300	0	300 USD	68.27%	204'798.60	0.01	a)
US961214EU39	1.0190 % WSTP 1.019 11/18/24	500	0	0	500 USD	96.98%	484'880.00	0.03	a)
US961214EY50	3.1330 % WSTP 3.133 11/18/41	0	300	0	300 USD	69.40%	208'189.80	0.01	a)
US961214FK48	5.4570 % WSTP 5.457 11/18/27	500	0	0	500 USD	101.80%	508'975.00	0.03	a)
US961214FN86	5.5350 % WSTP 5.535 11/17/28	0	700	0	700 USD	102.58%	718'069.80	0.04	a)
US961214FP35	6.8200 % WSTP 6.82 11/17/33	0	250	0	250 USD	107.13%	267'821.50	0.02	a)
US96145DAH89	4.0000 % WRK 4 03/15/28	500	0	0	500 USD	95.56%	477'778.00	0.03	a)
US963320AV88	4.5000 % WHR 4 1/2 06/01/46	200	0	0	200 USD	80.26%	160'518.00	0.01	a)
US963320AW61	4.7500 % WHR 4 3/4 02/26/29	200	0	0	200 USD	97.65%	195'306.60	0.01	a)
US963320AX45	4.6000 % WHR 4.6 05/15/50	0	240	0	240 USD	79.80%	191'521.44	0.01	a)
US969457BW96	4.5500 % WMB 4.55 06/24/24	585	0	585	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US969457BX79	3.5000 % WMB 3 1/2 11/15/30	400	0	0	400 USD	90.29%	361'164.00	0.02	a)
US969457BY52	2.6000 % WMB 2.6 03/15/31	200	0	0	200 USD	84.12%	168'246.60	0.01	a)
US969457CA67	5.3000 % WMB 5.3 08/15/52	0	220	0	220 USD	93.71%	206'153.86	0.01	a)
US969457CJ76	5.6500 % WMB 5.65 03/15/33	0	220	0	220 USD	101.27%	222'791.14	0.01	a)
US969457CK40	5.3000 % WMB 5.3 08/15/28	0	300	0	300 USD	100.53%	301'599.90	0.02	a)
US96949LAB18	4.0000 % WMB 4 09/15/25	200	0	0	200 USD	98.13%	196'250.00	0.01	a)
US96949LAC90	5.1000 % WMB 5.1 09/15/45	90	0	0	90 USD	91.48%	82'328.04	0.01	a)
US96949LAD73	3.7500 % WMB 3 3/4 06/15/27	200	400	0	600 USD	96.10%	576'599.40	0.04	a)
US96949LAE56	4.8500 % WMB 4.85 03/01/48	300	0	0	300 USD	87.85%	263'544.60	0.02	a)
US96950FAF18	6.3000 % WMB 6.3 04/15/40	500	0	0	500 USD	103.78%	518'905.50	0.03	a)
US96950FAN42	5.4000 % WMB 5.4 03/04/44	250	0	0	250 USD	94.06%	235'160.50	0.01	a)
US96950FAP99	4.9000 % WMB 4.9 01/15/45	200	0	0	200 USD	88.30%	176'604.60	0.01	a)
US96950FAQ72	3.9000 % WMB 3.9 01/15/25	250	0	0	250 USD	98.60%	246'505.00	0.02	a)
US970648AG61	4.5000 % WTW 4 1/2 09/15/28	200	100	200	100 USD	97.12%	97'117.30	0.01	a)
US970648AJ01	2.9500 % WTW 2.95 09/15/29	500	290	500	290 USD	88.67%	257'151.41	0.02	a)
US970648AK73	3.8750 % WTW 3 7/8 09/15/49	0	150	0	150 USD	74.60%	111'901.05	0.01	a)
US970648AL56	4.6500 % WTW 4.65 06/15/27	0	350	0	350 USD	97.95%	342'813.10	0.02	a)
US970648AM30	5.3500 % WTW 5.35 05/15/33	0	300	0	300 USD	98.25%	294'750.00	0.02	a)
US976656CN66	4.7500 % WEC 4 3/4 09/30/32	0	200	0	200 USD	97.82%	195'648.80	0.01	a)
US98138HAG65	3.5000 % WDAY 3 1/2 04/01/27	500	0	0	500 USD	95.28%	476'379.50	0.03	a)
US98138HAJ05	3.8000 % WDAY 3.8 04/01/32	500	0	0	500 USD	90.10%	450'480.50	0.03	a)
US983024AG50	6.5000 % PFE 6 1/2 02/01/34	300	0	0	300 USD	109.85%	329'535.30	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 USD	in % 7)	Kat.
US983024AL46	6.0000 % PFE 6 02/15/36	445	0	0	445 USD	106.54%	474'121.25	0.03	a)
US983024AN02	5.9500 % PFE 5.95 04/01/37	650	0	0	650 USD	105.93%	688'558.65	0.04	a)
US98389BAU44	3.3500 % XEL 3.35 12/01/26	250	0	0	250 USD	95.33%	238'326.25	0.01	a)
US98389BAW00	2.6000 % XEL 2.6 12/01/29	500	0	0	500 USD	87.53%	437'645.00	0.03	a)
US983919AJ06	2.9500 % AMD 2.95 06/01/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US98419MAJ99	3.2500 % XYL 3 1/4 11/01/26	250	200	0	450 USD	95.49%	429'693.75	0.03	a)
US98419MAL46	2.2500 % XYL 2 1/4 01/30/31	0	400	0	400 USD	83.49%	333'974.40	0.02	a)
US98419MAM29	1.9500 % XYL 1.95 01/30/28	200	200	0	400 USD	89.20%	356'804.00	0.02	a)
US98956PAS11	3.0500 % ZBH 3.05 01/15/26	0	500	0	500 USD	95.68%	478'416.50	0.03	a)
US98956PAV40	2.6000 % ZBH 2.6 11/24/31	0	200	0	200 USD	83.90%	167'806.00	0.01	a)
US98956PAX06	5.3500 % ZBH 5.35 12/01/28	0	200	0	200 USD	101.26%	202'515.20	0.01	a)
US98978VAH69	4.7000 % ZTS 4.7 02/01/43	850	0	0	850 USD	91.57%	778'308.45	0.05	a)
US98978VAL71	3.0000 % ZTS 3 09/12/27	500	0	0	500 USD	93.61%	468'030.50	0.03	a)
US98978VAM54	3.9500 % ZTS 3.95 09/12/47	0	200	0	200 USD	80.58%	161'164.80	0.01	a)
US98978VAS25	2.0000 % ZTS 2 05/15/30	0	200	0	200 USD	83.66%	167'312.40	0.01	a)
US98978VAT08	3.0000 % ZTS 3 05/15/50	0	100	0	100 USD	68.35%	68'348.90	0.00	a)
US98978VAV53	5.6000 % ZTS 5.6 11/16/32	400	0	0	400 USD	103.37%	413'468.00	0.03	a)
USG0114MAA56	6.4500 % AER 6.45 04/15/27 REGS	0	457	0	457 USD	102.45%	468'201.07	0.03	a)
USN8438JAB46	5.5000 % SUZANO 5 1/2 01/17/27	0	800	0	800 USD	99.34%	794'711.20	0.05	a)
USU1109MAU00	3.4190 % AVGO 3.419 04/15/33 REGS	1'500	0	0	1'500 USD	85.57%	1'283'505.00	0.08	a)
USU1109MAV82	3.4690 % AVGO 3.469 04/15/34 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	84.51%	845'120.00	0.05	a)
USU1109MAW65	3.1370 % AVGO 3.137 11/15/35 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	79.49%	874'434.00	0.05	a)
USU1109MAX49	3.1870 % AVGO 3.187 11/15/36 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	78.29%	782'900.00	0.05	a)
USU1109MBA37	4.9260 % AVGO 4.926 05/15/37 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	93.34%	933'440.00	0.06	a)
USU59340AH90	3.4000 % MSFT 3.4 09/15/26 REGS	0	400	0	400 USD	96.81%	387'252.00	0.02	a)
USU59340AK20	1.3500 % MSFT 1.35 09/15/30 REGS	0	140	140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU59340AM85	2.5000 % MSFT 2 1/2 09/15/50 REGS	0	430	0	430 USD	63.64%	273'664.90	0.02	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	0	300	0	300 USD	99.78%	299'334.00	0.02	a)
XS0460071078	5.5200 % DB 5.52 09/01/28 EMTN	0	300	0	300 USD	101.10%	303'291.00	0.02	a)
XS0985567881	6.3750 % CHIOLI 6 3/8 10/29/43	0	200	0	200 USD	96.30%	192'594.00	0.01	a)
XS1064799841	4.7500 % MAFUAE 4 3/4 05/07/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1075180379	6.4500 % CHIOLI 6.45 06/11/34	0	200	0	200 USD	102.37%	204'738.00	0.01	a)
XS1077883012	3.5000 % ETISLT 3 1/2 06/18/24 GMTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1120403313	4.3250 % DIFCAE 4.325 11/12/24	200	0	0	200 USD	98.91%	197'820.00	0.01	a)
XS1144495808	6.7500 % QBEAU 6 3/4 12/02/44	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1213177295	3.6250 % HKTGHD 3 5/8 04/02/25	200	200	0	400 USD	98.03%	392'136.00	0.02	a)
XS1227947097	4.0000 % CHGDNU 4 05/19/25	200	0	0	200 USD	98.28%	196'566.00	0.01	a)
XS1234958459	4.1250 % BJSTAT 4 1/8 05/26/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1242348164	3.8750 % GLPSP 3 7/8 06/04/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1253849357	3.2500 % STSP 3 1/4 06/30/25 EMTN	500	0	0	500 USD	97.57%	487'825.00	0.03	a)
XS1261170515	5.7500 % SRENVX 5 3/4 08/15/50	500	0	0	500 USD	98.88%	494'375.00	0.03	a)
XS1269724826	4.7500 % CMHI 4 3/4 08/03/25	400	0	0	400 USD	99.06%	396'252.00	0.02	a)
XS1308339420	4.0000 % CHGDNU 4 11/05/25	0	300	0	300 USD	98.14%	294'429.00	0.02	a)
XS1308713723	4.5000 % MAFUAE 4 1/2 11/03/25	200	0	0	200 USD	98.00%	196'000.00	0.01	a)
XS1382802095	4.3570 % AXIATA 4.357 03/24/26 EMTN	0	200	0	200 USD	97.75%	195'500.00	0.01	a)
XS1423722823	5.8750 % QBEAU 5 7/8 06/17/46 EMTN	0	200	0	200 USD	98.65%	197'298.00	0.01	a)
XS1423777215	5.6250 % SRENVX 5 5/8 08/15/52	500	0	0	500 USD	98.25%	491'250.00	0.03	a)
XS1431266920	3.7000 % CITLTD 3 7/8 06/14/26 EMTN	200	0	0	200 USD	96.69%	193'380.00	0.01	a)
XS1438451848	3.0000 % HKTGHD 3 07/14/26	0	600	0	600 USD	94.70%	568'218.00	0.04	a)
XS1488480333	3.6350 % EMAAR 3.635 09/15/26 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1497633179	2.3750 % STSP 2 3/8 10/03/26 EMTN	0	200	0	200 USD	93.74%	187'486.00	0.01	a)
XS1509084775	2.5000 % MTRC 2 1/2 11/02/26 DIP	0	200	0	200 USD	94.22%	188'448.00	0.01	a)
XS1551355149	4.2500 % GENTMK 4 1/4 01/24/27	400	0	0	400 USD	95.65%	382'584.00	0.02	a)
XS1570263563	3.8750 % CITLTD 3 7/8 02/28/27 EMTN	200	0	0	200 USD	96.71%	193'414.00	0.01	a)
XS1644429935	4.1250 % HAOHUA 4 1/8 07/19/27	500	0	0	500 USD	96.05%	480'255.00	0.03	a)
XS1692177774	4.3750 % ORIEAS 4 3/8 12/21/27 EMTN	200	0	0	200 USD	95.34%	190'684.00	0.01	a)
XS1713193586	3.9750 % VNKRL 3.975 11/09/27 EMTN	0	500	0	500 USD	55.00%	275'000.00	0.02	a)
XS1733841735	3.7500 % CHGDNU 3 3/4 12/11/27	200	0	0	200 USD	95.73%	191'456.00	0.01	a)
XS1743535491	4.5000 % LNGFOR 4 1/2 01/16/28	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1743727130	4.0000 % CITLTD 4 01/11/28 EMTN	250	0	0	250 USD	96.37%	240'915.00	0.02	a)
XS1788513734	5.1250 % HAOHUA 5 1/8 03/14/28	300	0	0	300 USD	99.11%	297'339.00	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 USD	in % 7)	Kat.
XS1788514039	4.8750 % HAOHUA 4 7/8 03/14/25	500	0	0	500 USD	99.16%	495'810.00	0.03	a)
XS1811821211	4.7500 % CHIOLI 4 3/4 04/26/28	0	200	0	200 USD	96.82%	193'646.00	0.01	a)
XS1856800450	5.0000 % CMHI 5 08/06/28	200	0	0	200 USD	100.28%	200'558.00	0.01	a)
XS1865437930	3.8750 % STSP 3 7/8 08/28/28 EMTN	400	0	0	400 USD	96.65%	386'600.00	0.02	a)
XS1873136607	5.0000 % NANFUN 5 09/05/28 EMTN	0	200	0	200 USD	95.38%	190'750.00	0.01	a)
XS1887479902	4.7500 % ALDAR 4 3/4 09/29/25	200	0	0	200 USD	98.75%	197'500.00	0.01	a)
XS1927705308	5.2500 % SNRSKY 5 1/4 03/11/24	1'000	0	0	1'000 USD	99.91%	999'130.00	0.06	a)
XS1936784161	4.2500 % CCB 4 1/4 02/27/29	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1938443329	4.0000 % BOCAVI 4 01/25/24 GMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1941781749	4.9740 % GLPCHI 4.974 02/26/24 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1950126109	4.1250 % CRHZCH 4 1/8 02/26/29 EMTN	250	0	0	250 USD	93.16%	232'892.50	0.01	a)
XS1956021585	4.2500 % MASQUH 4 1/4 02/26/24 EMTN	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1964701822	5.3750 % ARNDTN 5 3/8 03/21/29 EMTN	0	200	0	200 USD	85.81%	171'614.00	0.01	a)
XS1989704843	3.2500 % SDIC 3 1/4 05/21/24 EMTN	200	0	0	200 USD	99.48%	198'964.00	0.01	a)
XS1992924552	3.5000 % CCBL 3 1/2 05/16/24 EMTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2011969651	3.3750 % HAOHUA 3 3/8 06/19/24	1'100	0	1'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2011969735	3.8750 % HAOHUA 3 7/8 06/19/29	0	300	0	300 USD	92.96%	278'886.00	0.02	a)
XS2014454933	2.7500 % CHGDNV 2 3/4 07/02/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2020663055	2.5000 % MITCO 2 1/2 07/09/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2026710553	3.8750 % DPWVU 3 7/8 07/18/29 EMTN	0	200	0	200 USD	93.25%	186'500.00	0.01	a)
XS2044279334	2.8200 % HYSAN 2.82 09/04/29 EMTN	200	0	0	200 USD	86.25%	172'494.00	0.01	a)
XS2046591413	2.3750 % STSP 2 3/8 08/28/29 EMTN	0	600	0	600 USD	88.68%	532'068.00	0.03	a)
XS2055636109	3.2500 % HKTGHD 3 1/4 09/30/29	0	200	0	200 USD	90.75%	181'500.00	0.01	a)
XS2099049699	2.8750 % SFHOLD 2 7/8 02/20/30	0	200	0	200 USD	87.91%	175'820.00	0.01	a)
XS2099130382	2.8750 % SUNHUN 2 7/8 01/21/30 EMTN	0	200	0	200 USD	87.91%	175'816.00	0.01	a)
XS2102904864	3.4250 % CHCOMU 3.425 PERP	500	0	0	500 USD	97.80%	488'980.00	0.03	a)
XS2102905168	3.6500 % CHCOMU 3.65 PERP	500	0	0	500 USD	95.10%	475'520.00	0.03	a)
XS2106056067	2.5000 % FABUH 2 1/2 01/21/25	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2109790001	2.8500 % CITLTD 2.85 02/25/30 EMTN	200	0	0	200 USD	88.18%	176'368.00	0.01	a)
XS2114850949	2.7500 % QNBK 2 3/4 02/12/27 EMTN	500	0	0	500 USD	93.20%	465'990.00	0.03	a)
XS2116905691	2.1250 % JIANYI 2 1/8 08/27/30	500	0	0	500 USD	84.13%	420'660.00	0.03	a)
XS2125601547	2.7500 % CHIOLI 2 3/4 03/02/30 EMTN	500	0	0	500 USD	85.55%	427'725.00	0.03	a)
XS2130065258	2.7500 % SUNHUN 2 3/4 05/13/30 EMTN	200	0	0	200 USD	86.71%	173'426.00	0.01	a)
XS2140041786	3.1250 % CHITRA 3 1/8 04/23/30	0	200	0	200 USD	89.98%	179'952.00	0.01	a)
XS2140531950	2.4500 % CCB 2.45 06/24/30	1'000	0	0	1'000 USD	96.23%	962'260.00	0.06	a)
XS2143035587	2.8750 % HKLSP 2 7/8 05/27/30 EMTN	0	200	0	200 USD	86.81%	173'628.00	0.01	a)
XS2152902479	1.6250 % CHGRID 1 5/8 08/05/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	82.92%	829'150.00	0.05	a)
XS2162033729	2.6250 % QNBK 2 5/8 05/12/25 EMTN	500	0	0	500 USD	96.33%	481'630.00	0.03	a)
XS2168040744	4.0000 % BNKEA 4 05/29/30 EMTN	1'000	500	0	1'500 USD	96.27%	1'444'050.00	0.09	a)
XS2176018609	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 05/21/26 GMTN	1'000	0	0	1'000 USD	93.99%	939'860.00	0.06	a)
XS2176021223	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 05/21/30 GMTN	1'500	0	0	1'500 USD	88.56%	1'328'445.00	0.08	a)
XS2179918037	2.0000 % CNPCCH 2 06/23/30	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2187635375	2.3750 % SHPORT 2 3/8 07/13/30	0	200	0	200 USD	86.30%	172'596.00	0.01	a)
XS2196334838	3.2500 % HIKLN 3 1/4 07/09/25	400	0	0	400 USD	95.73%	382'908.00	0.02	a)
XS2201858938	1.2000 % ICBCAS 1.2 07/20/25 GMTN	0	800	0	800 USD	94.62%	756'984.00	0.05	a)
XS2207824843	1.8750 % CMINLE 1 7/8 08/12/25 EMTN	200	0	0	200 USD	95.04%	190'084.00	0.01	a)
XS2208275854	1.6250 % POWINV 1 5/8 07/27/25 EMTN	0	700	0	700 USD	94.96%	664'741.00	0.04	a)
XS2211037184	2.6250 % CONAMP 2 5/8 09/17/30	200	0	0	200 USD	85.16%	170'326.00	0.01	a)
XS2213668085	1.6250 % MTRC 1 5/8 08/19/30 EMTN	0	250	0	250 USD	82.67%	206'685.00	0.01	a)
XS2216900105	2.1630 % AXIATA 2.163 08/19/30 EMTN	0	400	0	400 USD	83.25%	333'000.00	0.02	a)
XS2216900287	3.0640 % AXIATA 3.064 08/19/50 EMTN	0	290	0	290 USD	67.33%	195'268.60	0.01	a)
XS2218691256	1.7500 % ICBCIL 1 3/4 08/25/25 EMTN	0	200	0	200 USD	94.56%	189'120.00	0.01	a)
XS2221839793	3.6250 % NANFUN 3 5/8 08/27/30 EMTN	200	0	0	200 USD	85.00%	170'000.00	0.01	a)
XS2226808165	3.0000 % HAOHUA 3 09/22/30	500	0	0	500 USD	86.78%	433'905.00	0.03	a)
XS2228113762	3.0000 % SABIC 3 09/14/50	0	200	0	200 USD	67.21%	134'412.00	0.01	a)
XS2229418145	1.8750 % CONAMP 1 7/8 09/17/25	200	0	0	200 USD	94.69%	189'386.00	0.01	a)
XS2236362849	1.6250 % HONHAI 1 5/8 10/28/25 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2236363227	2.5000 % HONHAI 2 1/2 10/28/30 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
XS2242171291	2.5000 % TABRED 2 1/2 10/21/27	200	0	0	200 USD	89.88%	179'750.00	0.01	a)
XS2243948457	2.2500 % BCHINA 2 1/4 10/22/30 EMTN	0	500	0	500 USD	84.77%	423'825.00	0.03	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	500	0	0	500 USD	81.48%	407'380.00	0.03	a)
XS2288890671	2.1250 % SKBTAM 2 1/8 01/26/26	400	0	0	400 USD	92.56%	370'248.00	0.02	a)
XS2289104577	1.7500 % BOCAVI 1 3/4 01/21/26 GMTN	400	0	0	400 USD	93.44%	373'752.00	0.02	a)
XS2289592607	2.0000 % CICCHK 2 01/26/26 EMTN	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2297060126	2.0000 % CDBLFD 2 03/04/26 EMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2302544353	2.6250 % FRESHK 2 5/8 03/03/24 EMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2318334120	2.0000 % HPHTSP 2 03/19/26	200	0	0	200 USD	93.51%	187'024.00	0.01	a)
XS2331713102	1.4600 % CCB 1.46 04/22/26 EMTN	0	200	0	200 USD	92.76%	185'512.00	0.01	a)
XS2333669518	1.8000 % CCBL 1.8 07/22/26 EMTN	200	0	0	200 USD	92.07%	184'144.00	0.01	a)
XS2338173680	2.5000 % ABDPOC 2 1/2 05/06/31 EMTN	200	200	0	400 USD	84.04%	336'152.00	0.02	a)
XS2343321399	4.7450 % ICBPJ 4.745 06/09/51	0	200	0	200 USD	79.63%	159'250.00	0.01	a)
XS2349180104	3.3980 % ICBPJ 3.398 06/09/31	0	300	0	300 USD	85.38%	256'125.00	0.02	a)
XS2352275171	1.5500 % SUMI 1.55 07/06/26 EMTN	400	0	0	400 USD	91.67%	366'672.00	0.02	a)
XS2356219084	3.7000 % EMAAR 3.7 07/06/31 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357744619	2.2500 % HKLSP 2 1/4 07/15/31 EMTN	400	0	0	400 USD	81.15%	324'600.00	0.02	a)
XS2358735830	1.1250 % CHGRID 1 1/8 09/08/26	0	200	0	200 USD	90.92%	181'842.00	0.01	a)
XS2372975040	2.8500 % PINGIN 2.85 08/12/31 EMTN	500	0	0	500 USD	82.09%	410'445.00	0.03	a)
XS2373796320	1.2500 % CMINLE 1 1/4 09/16/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2381043350	1.6250 % ICBCAS 1 5/8 10/28/26 GMTN	0	500	0	500 USD	91.76%	458'790.00	0.03	a)
XS2387263440	1.5000 % HPHTSP 1 1/2 09/17/26	200	0	0	200 USD	90.88%	181'756.00	0.01	a)
XS2387357341	1.5000 % SINOCH 1 1/2 09/23/26 EMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2387368975	2.3750 % SINOCH 2 3/8 09/23/31 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2389983011	2.3750 % SFHOLD 2 3/8 11/17/26	200	0	0	200 USD	92.68%	185'354.00	0.01	a)
XS2389983524	3.1250 % SFHOLD 3 1/8 11/17/31	200	0	0	200 USD	86.59%	173'184.00	0.01	a)
XS2393958488	2.2500 % ICBCIL 2 1/4 11/02/26 EMTN	0	200	0	200 USD	92.50%	184'998.00	0.01	a)
XS2399787899	3.5410 % ICBPJ 3.541 04/27/32	0	200	0	200 USD	85.25%	170'500.00	0.01	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	500	0	0	500 USD	88.40%	442'010.00	0.03	a)
XS2414130711	3.0000 % HKTGHD 3 01/18/32	400	0	0	400 USD	85.33%	341'300.00	0.02	a)
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	500	0	0	500 USD	82.62%	413'085.00	0.03	a)
XS2423359459	4.8750 % BNKEA 4 7/8 04/22/32 EMTN	0	250	0	250 USD	92.99%	232'475.00	0.01	a)
XS2428943752	2.1940 % MITSCO 2.194 01/19/27	250	0	0	250 USD	92.27%	230'677.50	0.01	a)
XS2431451041	2.7000 % ICBCIL 2.7 01/27/27 EMTN	0	200	0	200 USD	93.41%	186'818.00	0.01	a)
XS2431453336	2.8500 % CCB 2.85 01/21/32	0	800	0	800 USD	94.04%	752'352.00	0.05	a)
XS2434699968	2.9500 % CHITRA 2.95 03/01/27	0	200	0	200 USD	94.43%	188'852.00	0.01	a)
XS2449907463	2.5910 % FABUH 2.591 03/02/27	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2477918846	4.0000 % CMHI 4 06/01/27	0	200	0	200 USD	96.98%	193'964.00	0.01	a)
XS2493296813	5.5000 % BSFR 5 1/2 11/23/27 EMTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2539374673	5.1250 % FABUH 5 1/8 10/13/27 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2584378025	4.8750 % BOCOM 4 7/8 02/28/26 EMTN	0	200	0	200 USD	99.79%	199'582.00	0.01	a)
XS2585576973	5.4930 % CICCHK 5.493 03/01/26 EMTN	0	300	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2592306752	5.5500 % SUMI 5.55 03/09/28 EMTN	0	400	0	400 USD	101.49%	405'968.00	0.03	a)
XS2607535684	4.7500 % RHIBAB 4 3/4 04/05/28	0	250	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2613209753	5.3530 % SUMIFL 5.353 04/25/28 EMTN	0	200	0	200 USD	99.90%	199'802.00	0.01	a)
XS2626291129	5.0000 % MAFUAE 5 06/01/33 EMTN	0	200	0	200 USD	98.00%	196'000.00	0.01	a)
XS2627338580	4.8750 % ALDAR 4 7/8 05/24/33	0	200	0	200 USD	97.38%	194'750.00	0.01	a)
XS2632485897	4.6250 % BCHINA 4 5/8 06/26/26 EMTN	0	400	0	400 USD	99.13%	396'512.00	0.02	a)
XS2634075399	7.5000 % MVMHU 7 1/2 06/09/28	0	1'000	0	1'000 USD	103.50%	1'035'000.00	0.06	a)
XS2638076187	7.7780 % ISPIM 7.778 06/20/54 REGS	0	600	0	600 USD	101.16%	606'972.00	0.04	a)
XS2641777235	5.2330 % ALMARA 5.233 07/25/33	0	250	0	250 USD	100.99%	252'465.00	0.02	a)
XS2648007495	5.4420 % CICCHK 5.442 07/18/26 GMTN	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2651081304	5.3750 % ADCBUH 5 3/8 07/18/28 GMTN	0	200	0	200 USD	101.09%	202'178.00	0.01	a)
XS2663498314	5.2500 % HTSC 5 1/4 08/09/26 EMTN	0	370	0	370 USD	100.26%	370'943.50	0.02	a)
XS2677030194	5.5000 % ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN	0	200	0	200 USD	101.59%	203'178.00	0.01	a)
XS2677631355	5.5000 % DPWDU 5 1/2 09/13/33	0	400	0	400 USD	100.75%	403'000.00	0.03	a)
XS2690029728	5.5090 % MITSCO 5.509 10/10/28 EMTN	0	200	0	200 USD	102.03%	204'060.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
XS2706163131	6.0000 % PIFKSA 6 10/25/28	0	650	0	650 USD	103.47%	672'555.00	0.04	a)
XS2706163305	6.2500 % PIFKSA 6 1/4 10/25/33	0	400	0	400 USD	108.38%	433'500.00	0.03	a)
USD							1'575'436'692.00	98.37	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall 06.07.2023	13'795'758	12'365'000	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 06.09.2023	3'900'000	4'411'695	CHF/USD	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	7'530'819.26	0.47
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'575'436'692.00	98.37
Sonstige Vermögenswerte	18'533'625.48	1.16
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'601'501'136.74	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-569.64	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'601'500'567.10	

Bewertungskategorien

	Kurswert USD	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);	1'575'436'692.00	98.37
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

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF	1 = USD	1.13565385
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA USD	USD	0.00 - 0.60	-	0.493	0.00 - 0.05	-	0.005
NT USD	USD	0.00 - 0.60	-	0.493	0.00 - 0.05	-	0.005

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max			Eff	Max
FA USD	0.200	0.500	0.100	0.100	3.000	
NT USD	-	-	-	-	3.000	

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

8 Benchmark

FTSE World Broad Investment-Grade US Dollar Corporate Bond Index TR

9 TER

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

10 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 USD	Ja	USD	3.40000	1.19000	2.21000

11 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
NT USD	Ja	USD	5.141	1.799	3.342

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Massnahme	Datum des Umtausches oder der Vereinigung
(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 (Vereinigungsstichtag).

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 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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	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) 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^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des 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 Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

zwei Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 25. Juli 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 25. Juli 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 25. Juli 2023:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)			Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)		
	ISIN	NAV pro Anteil		ISIN	NAV pro Anteil
FA CHF	CH0315621307	70.93	FA CHF	CH1270020246	70.93
DT CHF	CH0117045291	79.46	FA CHF	CH1270020246	70.93
GT CHF	CH0342828479	76.10	GT CHF	CH1270020279	76.10
NT CHF	CH0117045283	80.75	NT CHF	CH1270020295	80.75

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergibt sich das folgende Umtauschverhältnis jeweils aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile am übernehmenden Teilvermögen):

Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Responsible Europe ex CH (übertragendes Teilvermögen)	
Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
FA CHF	1 ↔ 1.0000000000
DT CHF	1 ↔ 1.1202372991
GT CHF	1 ↔ 1.0000000000
NT CHF	1 ↔ 1.0000000000

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 8. August 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) per 25. Juli 2023 geprüft.

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

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

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung der oben erwähnten Teilvermögen korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt."

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, 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, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

ein Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

Die mit Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds angekündigte Vereinigung von Anteilsklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds wurde vollzogen.

Nachstehend wird für das genannte Teilvermögen das Umtauschverhältnis für die Vereinigung der übertragenden Anteilsklasse mit der übernehmenden Anteilsklasse basierend auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 10. August 2023 aufgeführt.

Anteilsklasse DTH1 CHF (übertragende)			Anteilsklasse FAH1 CHF (übernehmende)			
Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil	Umtauschverhältnis	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
DTH1 CHF	CH0117045325	93.42	1 ↔ 1.2900884308	FAH1 CHF	CH0315621315	72.41

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass die Frist zur Erhebung von Einwendungen gegen die oben erwähnte Vereinigung von Anteilsklassen abgelaufen ist und Einwendungen gegen diese Vereinigung nicht mehr möglich sind.

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Teil II Ziff. 2 und 5 der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge erstreckt.

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund 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:

Teilvermögen	Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)
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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem wird bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung).

Es werden überdies bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect Änderungen in den bestehenden Gating-Bestimmungen vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.2 dieser Veröffentlichung).

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

1 Änderungen der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, soll gestrichen werden.

2 Gating-Verfahren

2.1 Einführung Gating-Verfahren bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen werden neue Bestimmungen betreffend Gating aufgenommen (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. §17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	mind.	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	mind.	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	mind.	CHF 20'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	mind.	CHF 20'000'000

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	CHF 25'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	CHF 60'000'000

2.2 Änderung des Gating-Verfahrens bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen bestehen bereits Bestimmungen betreffend Gating, welche neu umfassend angepasst werden (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

- | | | |
|---|-------|-----------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | mind. | CNY 400'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | mind. | CHF 10'000'000 |

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

- | | |
|---|-------------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | CNY 1'200'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | CHF 10'000'000 |

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

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser

Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 23. November 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"

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Mit Veröffentlichung vom 23. November 2023 wurden, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, von der Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, diverse Anpassungen des Fondsvertrages beantragt.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist unter anderem die **Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**. Diese Anpassung beabsichtigt, dass die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, gestrichen werden soll (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der Veröffentlichung vom 23. November 2023).

In Zusammenhang mit der geplanten Änderung wird in der gleichen Bestimmung (in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages) zudem neu die Regelung ergänzt, dass Investitionen in Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich