

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

Jahresbericht per 28.02.2023

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

| Klasse | Valor | Währung |
|---------------|--------------|----------------|
| FA CHF | 114034068 | CHF |
| GT CHF | 114034069 | CHF |
| NT CHF | 114034070 | CHF |

Rechnungswährung: CHF

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

Zürich, 28. Juni 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

Swisscanto (CH) Index Fund V, Zürich

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 USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ 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 Responsible¹
- ▶ 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

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible.

- ▶ Swissscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Commodity Fund

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, 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 beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swissscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate 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 Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, 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 | 3 |
| 2 | Vertriebsorganisation | 4 |
| 3 | Abschlusszahlen | 5 |
| 4 | Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I | 26 |
| 5 | Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung | 26 |
| 6 | Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte | 27 |
| 7 | Pauschale Verwaltungskommission | 27 |
| 8 | Benchmark | 27 |
| 9 | TER | 27 |
| 10 | Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023 | 28 |
| 11 | Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023 | 28 |
| 12 | Fussnoten | 28 |
| 13 | Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen | 29 31 |

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (03.01.2023)
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 | 01.03.2022 | 04.11.2021 |
|---|------------|------------------|------------------|
| | bis | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
| Konsolidiert | | | |
| | CHF | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 1'627'502'081.77 | 1'305'104'925.17 |
| Klasse FA CHF | | | |
| | CHF | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 8'632'873.28 | 3'334'651.13 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 97'090.678 | 34'443.647 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 88.9156 | 96.8147 |
| Ausschüttung je Anteil | | 0.65 | - |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 0.18 % | 0.18 % |
| Klasse GT CHF | | | |
| | CHF | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 350'184'239.78 | 267'262'270.06 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 3'936'444.429 | 2'759'933.150 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 88.9595 | 96.8365 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR | | 89.5005 | 93.9719 |
| Thesaurierung je Anteil | | 0.63 | 0.14 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 0.11 % | 0.11 % |
| Klasse NT CHF | | | |
| | CHF | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 1'268'684'968.71 | 1'034'508'003.98 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 14'242'680.935 | 10'679'303.775 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 89.0763 | 96.8704 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR | | 89.6180 | 94.0047 |
| Thesaurierung je Anteil | | 0.73 | 0.18 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 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

| | 2022 / 2023 | 2022 | 2021 | 2020 |
|---------------------------------------|-------------|----------|---------|------|
| Klasse FA CHF (Lancierung 04.11.2021) | -8.16 % | -11.82 % | 0.04 % | - |
| Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021) | -8.08 % | -11.75 % | 0.06 % | - |
| Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021) | -7.98 % | -11.65 % | 0.07 % | - |
| Benchmark | -8.22 % | -12.10 % | -0.16 % | - |
| Tracking Error 33) | 0.20 % | 0.27 % | 0.23 % | - |

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

Tracking Differenz

Klasse

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Klasse FA CHF (Lancierung 04.11.2021) | 0.06 % |
| Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021) | 0.14 % |
| Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021) | 0.24 % |

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 abweichenden Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

| (Verkehrswerte) | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 10'322'443.08 | 12'332'331.78 |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 1'155'315'146.89 | 916'055'887.69 |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 453'499'429.73 | 371'677'677.85 |
| Sonstige Vermögenswerte | 8'395'433.00 | 5'062'019.62 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 1'627'532'452.70 | 1'305'127'916.94 |
| Andere Verbindlichkeiten | -30'370.93 | -22'991.77 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 1'627'502'081.77 | 1'305'104'925.17 |

Entwicklung der Anzahl Anteile

| Klasse FA CHF | von bis | Lancierung | |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| | | 01.03.2022 28.02.2023 | 04.11.2021 28.02.2022 |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 34'443.647 | - |
| Ausgegebene Anteile | | 98'366.085 | 34'543.647 |
| Zurückgenommene Anteile | | -35'719.054 | -100.000 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 97'090.678 | 34'443.647 |

| Klasse GT CHF | von bis | Lancierung | |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| | | 01.03.2022 28.02.2023 | 04.11.2021 28.02.2022 |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 2'759'933.150 | - |
| Ausgegebene Anteile | | 1'729'044.500 | 2'846'953.950 |
| Zurückgenommene Anteile | | -552'533.221 | -87'020.800 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 3'936'444.429 | 2'759'933.150 |

| Klasse NT CHF | von bis | Lancierung | |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| | | 01.03.2022 28.02.2023 | 04.11.2021 28.02.2022 |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 10'679'303.775 | - |
| Ausgegebene Anteile | | 3'926'322.028 | 9'539'029.943 |
| Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen) | | 1'487'145.022 | 1'590'691.427 |
| Zurückgenommene Anteile | | -1'850'089.890 | -450'417.595 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 14'242'680.935 | 10'679'303.775 |

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

| | Datum | Gegenwert | Anteile |
|---------------|------------|----------------|---------------|
| Klasse NT CHF | 25.08.2022 | 6'836'982.41 | 75'240.981 |
| Klasse NT CHF | 25.08.2022 | 7'222'863.07 | 79'487.597 |
| Klasse NT CHF | 22.11.2022 | 120'969'689.23 | 1'332'416.444 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| Konsolidiert | von bis | 01.03.2022 28.02.2023 | 04.11.2021 28.02.2022 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode | | 1'305'104'925.17 | 0.00 |
| Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | | -893'739.17 | 0.00 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | | 434'938'528.38 | 1'343'332'766.96 |
| Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung | | -111'647'632.61 | -38'227'841.79 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 1'627'502'081.77 | 1'305'104'925.17 |

Erfolgsrechnung

| Konsolidiert | von bis | 01.03.2022 28.02.2023 | 04.11.2021 28.02.2022 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Ertrag | | | |
| Erträge der Bankguthaben auf Sicht | | 0.00 | 0.10 |
| Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht | | -35'413.31 | -33'531.84 |
| Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte | | 9'850'214.21 | 2'115'414.19 |
| Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | 1'723'431.39 | 0.00 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | | 2'920'478.63 | 428'543.90 |
| Total Ertrag | | 14'458'710.92 | 2'510'426.35 |
| Aufwand | | | |
| Reglementarische Vergütungen | | -336'863.19 | -95'146.27 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | | -1'051'401.01 | -55'199.32 |
| Total Aufwand | | -1'388'264.20 | -150'345.59 |
| Nettoertrag / Verlust | | 13'070'446.72 | 2'360'080.76 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | -3'689'857.81 | 189'974.89 |
| Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen | | 1'406'819.40 | 4'120'476.98 |
| Realisierter Erfolg | | 10'787'408.31 | 6'670'532.63 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | -122'435'040.92 | -44'898'374.42 |
| Gesamterfolg | | -111'647'632.61 | -38'227'841.79 |

Verwendung des Erfolges

| Klasse FA CHF | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
|--|----------------------|---------------------|
| Nettoertrag | 63'530.59 | 4'347.96 |
| Vortrag des Vorjahres | 4'347.96 | 0.00 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 67'878.55 | 4'347.96 |
| Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg | 63'108.94 | 0.00 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 4'769.61 | 4'347.96 |
| Total | 67'878.55 | 4'347.96 |
| Klasse GT CHF | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
| Nettoertrag | 2'506'117.87 | 407'461.83 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 2'506'117.87 | 407'461.83 |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 877'141.25 | 142'611.64 |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 1'628'976.62 | 264'850.19 |
| Total | 2'506'117.87 | 407'461.83 |
| Klasse NT CHF | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
| Nettoertrag | 10'500'798.26 | 1'948'270.97 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 10'500'798.26 | 1'948'270.97 |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 3'675'279.39 | 681'894.84 |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 6'825'518.87 | 1'266'376.13 |
| Total | 10'500'798.26 | 1'948'270.97 |

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

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|--|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------|------|
| Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind | | | | | | | 1'155'315'146.89 | 70.99 | |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | | | | | | | 1'155'315'146.89 | 70.99 | |
| CH0008435569 | 4.0000 % SWISS 4 02/11/23 | 8'770 | 0 | 8'770 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0008680370 | 4.0000 % SWISS 4 04/08/28 | 12'960 | 6'350 | 0 | 19'310 CHF | 112.81% | 21'783'611.00 | 1.34 | a) |
| CH0009755197 | 4.0000 % SWISS 4 01/06/49 | 6'360 | 2'850 | 0 | 9'210 CHF | 154.33% | 14'213'793.00 | 0.87 | a) |
| CH0015803239 | 3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33 | 10'400 | 2'250 | 0 | 12'650 CHF | 118.90% | 15'040'850.00 | 0.92 | a) |
| CH0020469075 | 2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30 | 1'410 | 200 | 0 | 1'610 CHF | 106.00% | 1'706'600.00 | 0.10 | a) |
| CH0020498645 | 2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25 | 1'690 | 200 | 0 | 1'890 CHF | 101.85% | 1'924'965.00 | 0.12 | a) |
| CH0020632144 | 2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30 | 2'720 | 1'350 | 0 | 4'070 CHF | 106.70% | 4'342'690.00 | 0.27 | a) |
| CH0021894602 | 2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN | 1'830 | 400 | 0 | 2'230 CHF | 101.70% | 2'267'910.00 | 0.14 | a) |
| CH0022268004 | 2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN | 2'910 | 950 | 0 | 3'860 CHF | 101.95% | 3'935'270.00 | 0.24 | a) |
| CH0022566175 | 2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25 | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 101.70% | 823'770.00 | 0.05 | a) |
| CH0023960328 | 2.3750 % NEDWBK 2 3/8 01/27/23 EMTN | 970 | 0 | 970 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0024141100 | 2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN | 1'580 | 0 | 0 | 1'580 CHF | 103.00% | 1'627'400.00 | 0.10 | a) |
| CH0024484187 | 2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36 | 1'720 | 200 | 0 | 1'920 CHF | 106.45% | 2'043'840.00 | 0.13 | a) |
| CH0024522747 | 2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 101.90% | 203'800.00 | 0.01 | a) |
| CH0024524966 | 2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 | 10'080 | 4'800 | 0 | 14'880 CHF | 111.58% | 16'603'104.00 | 1.02 | a) |
| CH0025185676 | 3.0000 % EUROF 3 05/15/26 | 2'870 | 900 | 0 | 3'770 CHF | 103.60% | 3'905'720.00 | 0.24 | a) |
| CH0025662831 | 3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN | 960 | 200 | 0 | 1'160 CHF | 103.55% | 1'201'180.00 | 0.07 | a) |
| CH0025826949 | 3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 109.70% | 1'097'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0025896942 | 3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN | 1'760 | 250 | 0 | 2'010 CHF | 114.40% | 2'299'440.00 | 0.14 | a) |
| CH0026096567 | 3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN | 560 | 600 | 0 | 1'160 CHF | 102.50% | 1'189'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0026213451 | 3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36 | 590 | 200 | 0 | 790 CHF | 114.50% | 904'550.00 | 0.06 | a) |
| CH0026233491 | 3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN | 1'110 | 0 | 0 | 1'110 CHF | 108.45% | 1'203'795.00 | 0.07 | a) |
| CH0026302304 | 3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN | 700 | 700 | 0 | 1'400 CHF | 109.70% | 1'535'800.00 | 0.09 | a) |
| CH0026674314 | 3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN | 390 | 500 | 0 | 890 CHF | 108.00% | 961'200.00 | 0.06 | a) |
| CH0026985520 | 2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN | 1'310 | 650 | 0 | 1'960 CHF | 107.75% | 2'111'900.00 | 0.13 | a) |
| CH0027752200 | 2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24 | 1'530 | 300 | 0 | 1'830 CHF | 101.50% | 1'857'450.00 | 0.11 | a) |
| CH0029008809 | 2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37 | 780 | 300 | 0 | 1'080 CHF | 110.00% | 1'188'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0030653916 | 3.0000 % EUROF 3 05/22/24 | 2'030 | 0 | 0 | 2'030 CHF | 101.50% | 2'060'450.00 | 0.13 | a) |
| CH0031084087 | 3.0000 % ZURCTY 3 06/08/22 | 670 | 0 | 670 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0031102061 | 3.0000 % OKB 3 06/14/22 | 670 | 0 | 670 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0031226134 | 3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424 | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 105.37% | 1'264'440.00 | 0.08 | a) |
| CH0031408112 | 3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN | 810 | 200 | 0 | 1'010 CHF | 101.55% | 1'025'655.00 | 0.06 | a) |
| CH0031409177 | 3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN | 130 | 220 | 0 | 350 CHF | 116.35% | 407'225.00 | 0.03 | a) |
| CH0031835561 | 3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27 | 9'110 | 1'000 | 0 | 10'110 CHF | 107.84% | 10'902'624.00 | 0.67 | a) |
| CH0033596476 | 3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27 | 400 | 300 | 0 | 700 CHF | 107.30% | 751'100.00 | 0.05 | a) |
| CH0033961746 | 3.3750 % PSHYPO 3 3/8 10/10/22 427 | 1'220 | 0 | 1'220 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0107134683 | 2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25 | 890 | 300 | 0 | 1'190 CHF | 101.90% | 1'212'610.00 | 0.07 | a) |
| CH0109152758 | 2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 101.40% | 405'600.00 | 0.02 | a) |
| CH0109155827 | 2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 101.55% | 822'555.00 | 0.05 | a) |
| CH0109497690 | 2.7500 % WINCTY 2 3/4 01/28/30 | 100 | 0 | 0 | 100 CHF | 104.45% | 104'450.00 | 0.01 | a) |
| CH0111008048 | 2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512 | 700 | 350 | 0 | 1'050 CHF | 104.05% | 1'092'525.00 | 0.07 | a) |
| CH0112933483 | 2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23 | 1'280 | 0 | 0 | 1'280 CHF | 100.23% | 1'282'995.20 | 0.08 | a) |
| CH0114260257 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 06/28/23 514 | 2'550 | 0 | 2'550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0114695403 | 1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25 | 1'560 | 0 | 0 | 1'560 CHF | 99.85% | 1'557'660.00 | 0.10 | a) |
| CH0114695429 | 2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28 | 500 | 350 | 0 | 850 CHF | 101.50% | 862'750.00 | 0.05 | a) |
| CH0115967397 | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519 | 2'780 | 500 | 0 | 3'280 CHF | 101.56% | 3'331'168.00 | 0.20 | a) |
| CH0116306868 | 2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 100.00% | 780'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0116403517 | 2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN | 280 | 350 | 0 | 630 CHF | 99.35% | 625'905.00 | 0.04 | a) |
| CH0117076379 | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524 | 2'780 | 550 | 0 | 3'330 CHF | 98.71% | 3'287'043.00 | 0.20 | a) |
| CH0118095667 | 1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26 | 400 | 200 | 0 | 600 CHF | 99.60% | 597'600.00 | 0.04 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0118532735 | 1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN | 330 | 200 | 0 | 530 CHF | 99.75% | 528'675.00 | 0.03 | a) |
| CH0118668257 | 2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN | 650 | 700 | 0 | 1'350 CHF | 101.65% | 1'372'275.00 | 0.08 | a) |
| CH0118886735 | 2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN | 280 | 0 | 0 | 280 CHF | 100.25% | 280'700.00 | 0.02 | a) |
| CH0119015086 | 2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405 | 1'000 | 600 | 0 | 1'600 CHF | 100.25% | 1'604'000.00 | 0.10 | a) |
| CH0119153663 | 2.0000 % KBBS 2 11/15/32 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 98.60% | 295'800.00 | 0.02 | a) |
| CH0119468368 | 2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34 | 470 | 0 | 0 | 470 CHF | 100.75% | 473'525.00 | 0.03 | a) |
| CH0119533278 | 3.1250 % CS 3 1/8 11/12/30 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0119729793 | 2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115 | 660 | 750 | 0 | 1'410 CHF | 98.20% | 1'384'620.00 | 0.09 | a) |
| CH0119858659 | 2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28 | 500 | 300 | 0 | 800 CHF | 101.15% | 809'200.00 | 0.05 | a) |
| CH0120168486 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533 | 1'550 | 800 | 0 | 2'350 CHF | 100.87% | 2'370'445.00 | 0.15 | a) |
| CH0122787606 | 2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 100.55% | 502'750.00 | 0.03 | a) |
| CH0123423276 | 2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 100.65% | 503'250.00 | 0.03 | a) |
| CH0124138840 | 2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544 | 500 | 800 | 0 | 1'300 CHF | 102.15% | 1'327'950.00 | 0.08 | a) |
| CH0124338937 | 2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548 | 400 | 800 | 0 | 1'200 CHF | 104.33% | 1'251'960.00 | 0.08 | a) |
| CH0124739902 | 2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN | 530 | 0 | 0 | 530 CHF | 101.75% | 539'275.00 | 0.03 | a) |
| CH0124855328 | 2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN | 600 | 0 | 0 | 600 CHF | 104.35% | 626'100.00 | 0.04 | a) |
| CH0125067774 | 2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN | 650 | 0 | 0 | 650 CHF | 105.55% | 686'075.00 | 0.04 | a) |
| CH0126116539 | 2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 101.75% | 681'725.00 | 0.04 | a) |
| CH0126183075 | 2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 100.08% | 720'576.00 | 0.04 | a) |
| CH0126519047 | 2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552 | 2'330 | 0 | 0 | 2'330 CHF | 101.75% | 2'370'775.00 | 0.15 | a) |
| CH0126645396 | 2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 103.30% | 206'600.00 | 0.01 | a) |
| CH0126875803 | 2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41 | 580 | 0 | 0 | 580 CHF | 107.40% | 622'920.00 | 0.04 | a) |
| CH0126977641 | 2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26 | 890 | 0 | 0 | 890 CHF | 101.30% | 901'570.00 | 0.06 | a) |
| CH0127181029 | 2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 | 7'190 | 4'450 | 0 | 11'640 CHF | 106.46% | 12'391'944.00 | 0.76 | a) |
| CH0127181169 | 1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42 | 11'270 | 3'800 | 0 | 15'070 CHF | 99.99% | 15'068'493.00 | 0.93 | a) |
| CH0127181177 | 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24 | 9'349 | 2'000 | 0 | 11'349 CHF | 100.05% | 11'354'674.50 | 0.70 | a) |
| CH0127181193 | 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37 | 10'010 | 3'700 | 0 | 13'710 CHF | 96.42% | 13'219'182.00 | 0.81 | a) |
| CH0127350376 | 2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410 | 500 | 400 | 0 | 900 CHF | 101.49% | 913'410.00 | 0.06 | a) |
| CH0127860192 | 2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN | 640 | 0 | 0 | 640 CHF | 100.15% | 640'960.00 | 0.04 | a) |
| CH0128833255 | 2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 104.75% | 419'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0128833289 | 2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30 | 100 | 0 | 0 | 100 CHF | 105.35% | 105'350.00 | 0.01 | a) |
| CH0128891105 | 2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553 | 0 | 1'300 | 0 | 1'300 CHF | 103.00% | 1'339'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0129766215 | 2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38 | 1'030 | 0 | 0 | 1'030 CHF | 107.65% | 1'108'795.00 | 0.07 | a) |
| CH0130158642 | 2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122 | 250 | 250 | 0 | 500 CHF | 102.90% | 514'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0131610740 | 2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 411 | 2'000 | 0 | 0 | 2'000 CHF | 100.25% | 2'005'000.00 | 0.12 | a) |
| CH0132176055 | 2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 101.06% | 757'950.00 | 0.05 | a) |
| CH0136611800 | 1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 99.75% | 299'250.00 | 0.02 | a) |
| CH0136847156 | 1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413 | 4'660 | 0 | 0 | 4'660 CHF | 99.56% | 4'639'496.00 | 0.29 | a) |
| CH0138760811 | 1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24 | 1'060 | 0 | 0 | 1'060 CHF | 99.65% | 1'056'290.00 | 0.06 | a) |
| CH0139458720 | 1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 99.55% | 776'490.00 | 0.05 | a) |
| CH0140819845 | 1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25 | 580 | 0 | 0 | 580 CHF | 99.50% | 577'100.00 | 0.04 | a) |
| CH0141219698 | 1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414 | 300 | 500 | 0 | 800 CHF | 99.54% | 796'320.00 | 0.05 | a) |
| CH0141833407 | 1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 99.55% | 895'950.00 | 0.06 | a) |
| CH0142054391 | 1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23 | 890 | 0 | 0 | 890 CHF | 100.13% | 891'157.00 | 0.05 | a) |
| CH0142132007 | 1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23 | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 100.02% | 250'060.00 | 0.02 | a) |
| CH0142132031 | 1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28 | 970 | 200 | 0 | 1'170 CHF | 98.50% | 1'152'450.00 | 0.07 | a) |
| CH0142337697 | 2.0000 % GENEVA 2 11/28/41 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 99.55% | 666'985.00 | 0.04 | a) |
| CH0142900775 | 1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 100.00% | 300'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0143383971 | 1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559 | 250 | 500 | 0 | 750 CHF | 92.67% | 695'025.00 | 0.04 | a) |
| CH0143808340 | 1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 97.80% | 293'400.00 | 0.02 | a) |
| CH0147144361 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562 | 600 | 1'500 | 0 | 2'100 CHF | 97.93% | 2'056'530.00 | 0.13 | a) |
| CH0148606137 | 2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24 | 1'460 | 0 | 0 | 1'460 CHF | 100.50% | 1'467'300.00 | 0.09 | a) |
| CH0149176163 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 99.60% | 498'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0149176171 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565 | 1'250 | 1'000 | 0 | 2'250 CHF | 91.34% | 2'055'150.00 | 0.13 | a) |
| CH0149317056 | 1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32 | 1'110 | 800 | 0 | 1'910 CHF | 96.30% | 1'839'330.00 | 0.11 | a) |
| CH0149549575 | 1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27 | 1'130 | 0 | 0 | 1'130 CHF | 98.05% | 1'107'965.00 | 0.07 | a) |
| CH0180006113 | 1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN | 1'050 | 0 | 0 | 1'050 CHF | 99.80% | 1'047'900.00 | 0.06 | a) |
| CH0180428531 | 2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0181215028 | 1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420 | 0 | 2'400 | 0 | 2'400 CHF | 97.90% | 2'349'600.00 | 0.14 | a) |
| CH0181377042 | 1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32 | 150 | 0 | 0 | 150 CHF | 96.35% | 144'525.00 | 0.01 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0181915734 | 1.7500 % OKB 1 3/4 05/24/23 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 100.09% | 400'360.00 | 0.02 | a) |
| CH0181932952 | 1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27 | 500 | 200 | 0 | 700 CHF | 97.40% | 681'800.00 | 0.04 | a) |
| CH0182337334 | 1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 95.70% | 641'190.00 | 0.04 | a) |
| CH0182484110 | 1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 98.50% | 394'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0182910882 | 1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422 | 1'000 | 1'200 | 0 | 2'200 CHF | 98.41% | 2'165'020.00 | 0.13 | a) |
| CH0184043542 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566 | 2'440 | 0 | 0 | 2'440 CHF | 98.37% | 2'400'228.00 | 0.15 | a) |
| CH0184249990 | 1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25 | 9'270 | 2'800 | 0 | 12'070 CHF | 100.40% | 12'118'280.00 | 0.74 | a) |
| CH0184636915 | 1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37 | 680 | 0 | 0 | 680 CHF | 92.20% | 626'960.00 | 0.04 | a) |
| CH0184911953 | 1.2500 % GENEVA 1 1/4 12/29/22 | 670 | 0 | 670 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0184911961 | 1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27 | 890 | 250 | 0 | 1'140 CHF | 98.70% | 1'125'180.00 | 0.07 | a) |
| CH0185258222 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423 | 3'700 | 0 | 0 | 3'700 CHF | 97.22% | 3'597'140.00 | 0.22 | a) |
| CH0185577837 | 1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 97.50% | 292'500.00 | 0.02 | a) |
| CH0185712822 | 1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 91.75% | 550'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0185754162 | 1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 97.70% | 654'590.00 | 0.04 | a) |
| CH0185831366 | 1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24 | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 99.20% | 248'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0185907083 | 1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN | 390 | 550 | 0 | 940 CHF | 98.30% | 924'020.00 | 0.06 | a) |
| CH0186162613 | 1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 99.53% | 826'074.10 | 0.05 | a) |
| CH0186472822 | 1.2500 % GRKPSW 1 1/4 06/14/24 | 800 | 0 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0188726852 | 1.5000 % ABNANV 1 1/2 07/18/23 EMTN | 760 | 0 | 0 | 760 CHF | 100.00% | 760'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0188927450 | 1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24 | 1'580 | 450 | 0 | 2'030 CHF | 99.84% | 2'026'752.00 | 0.12 | a) |
| CH0189069732 | 1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 99.17% | 297'510.00 | 0.02 | a) |
| CH0190125036 | 1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN | 1'050 | 0 | 0 | 1'050 CHF | 98.15% | 1'030'575.00 | 0.06 | a) |
| CH0190361029 | 1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 99.29% | 297'870.00 | 0.02 | a) |
| CH0190369378 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569 | 1'000 | 1'050 | 0 | 2'050 CHF | 94.55% | 1'938'275.00 | 0.12 | a) |
| CH0192241278 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 97.63% | 976'300.00 | 0.06 | a) |
| CH0193069835 | 1.1250 % BNG 1 1/8 09/13/22 EMTN | 440 | 0 | 440 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0193265995 | 1.0000 % GLRNKB 1 09/21/22 | 300 | 0 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0193395537 | 1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 99.50% | 557'200.00 | 0.03 | a) |
| CH0193717540 | 1.0000 % PFZENT 1 09/09/22 425 | 1'890 | 100 | 1'990 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0193744916 | 1.0000 % ZUGKAN 1 09/26/22 | 610 | 0 | 610 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0194273204 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574 | 0 | 2'700 | 0 | 2'700 CHF | 96.23% | 2'598'210.00 | 0.16 | a) |
| CH0194695117 | 1.0000 % BERN 1 10/25/24 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 98.75% | 553'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0194695216 | 1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 98.10% | 490'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0196878661 | 1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23 | 890 | 0 | 890 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0198323484 | 1.0000 % THURBK 1 11/30/22 | 500 | 0 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0199347680 | 1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37 | 580 | 200 | 0 | 780 CHF | 90.90% | 709'020.00 | 0.04 | a) |
| CH0199419992 | 1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29 | 530 | 0 | 0 | 530 CHF | 95.40% | 505'620.00 | 0.03 | a) |
| CH0199543544 | 1.0000 % ZURICH 1 12/03/25 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 97.85% | 812'155.00 | 0.05 | a) |
| CH0199543569 | 1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32 | 100 | 600 | 0 | 700 CHF | 94.75% | 663'250.00 | 0.04 | a) |
| CH0199773232 | 1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27 | 1'050 | 400 | 0 | 1'450 CHF | 96.85% | 1'404'325.00 | 0.09 | a) |
| CH0200370218 | 0.8750 % EGW 0 7/8 03/24/23 44 | 440 | 0 | 0 | 440 CHF | 99.99% | 439'964.80 | 0.03 | a) |
| CH0203695629 | 0.8750 % KUNTA 0 7/8 02/01/23 EMTN | 670 | 0 | 670 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0203872863 | 1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129 | 1'140 | 0 | 0 | 1'140 CHF | 99.35% | 1'132'590.00 | 0.07 | a) |
| CH0204017005 | 1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 99.47% | 686'343.00 | 0.04 | a) |
| CH0204276213 | 1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36 | 0 | 250 | 0 | 250 CHF | 91.90% | 229'750.00 | 0.01 | a) |
| CH0204365651 | 1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28 | 890 | 0 | 0 | 890 CHF | 97.35% | 866'415.00 | 0.05 | a) |
| CH0204477290 | 1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 100.01% | 560'056.00 | 0.03 | a) |
| CH0204567256 | 1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429 | 2'000 | 1'200 | 0 | 3'200 CHF | 97.51% | 3'120'320.00 | 0.19 | a) |
| CH0204975426 | 1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28 | 1'190 | 0 | 0 | 1'190 CHF | 98.25% | 1'169'175.00 | 0.07 | a) |
| CH0205276725 | 1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 98.00% | 490'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0205310904 | 1.1250 % KBSCHW 1 1/8 02/20/23 | 500 | 0 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0205500017 | 1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43 | 110 | 600 | 0 | 710 CHF | 92.95% | 659'945.00 | 0.04 | a) |
| CH0206728823 | 1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28 | 400 | 200 | 0 | 600 CHF | 98.55% | 591'300.00 | 0.04 | a) |
| CH0206894740 | 1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25 | 1'100 | 0 | 1'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0206992270 | 1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27 | 670 | 300 | 0 | 970 CHF | 98.00% | 950'600.00 | 0.06 | a) |
| CH0207413185 | 1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38 | 280 | 400 | 0 | 680 CHF | 98.20% | 667'760.00 | 0.04 | a) |
| CH0208200581 | 1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 97.95% | 293'850.00 | 0.02 | a) |
| CH0208271541 | 3.0000 % KWLILI 3 04/02/48 | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0208323441 | 1.2500 % GENEVA 1 1/4 03/22/23 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 100.01% | 560'067.20 | 0.03 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0208323458 | 1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 98.35% | 688'450.00 | 0.04 | a) |
| CH0208580693 | 1.1250 % KBFRI 1 1/8 03/28/23 | 940 | 0 | 0 | 940 CHF | 99.99% | 939'906.00 | 0.06 | a) |
| CH0208897592 | 1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38 | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 92.50% | 582'750.00 | 0.04 | a) |
| CH0209654984 | 1.1250 % LANSBK 1 1/8 04/11/23 EMTN | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 99.98% | 559'888.00 | 0.03 | a) |
| CH0209782033 | 1.1250 % GENCTY 1 1/8 04/17/23 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 99.97% | 299'910.00 | 0.02 | a) |
| CH0210240310 | 1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 98.91% | 791'280.00 | 0.05 | a) |
| CH0210461312 | 1.1250 % KBSH 1 1/8 04/24/23 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 99.96% | 399'840.00 | 0.02 | a) |
| CH0211588915 | 1.2500 % PSHYPO 1 1/4 09/29/23 580 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 99.80% | 2'654'680.00 | 0.16 | a) |
| CH0211588949 | 1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 97.34% | 1'654'780.00 | 0.10 | a) |
| CH0212114653 | 1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43 | 0 | 390 | 0 | 390 CHF | 95.75% | 373'425.00 | 0.02 | a) |
| CH0212459561 | 1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 97.85% | 812'155.00 | 0.05 | a) |
| CH0212937244 | 1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25 | 330 | 0 | 0 | 330 CHF | 99.55% | 328'515.00 | 0.02 | a) |
| CH0214010677 | 1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43 | 220 | 300 | 0 | 520 CHF | 92.90% | 483'080.00 | 0.03 | a) |
| CH0214925874 | 1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28 | 1'020 | 0 | 0 | 1'020 CHF | 98.50% | 1'004'700.00 | 0.06 | a) |
| CH0214925882 | 1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43 | 330 | 200 | 0 | 530 CHF | 96.30% | 510'390.00 | 0.03 | a) |
| CH0215064350 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 97.71% | 781'680.00 | 0.05 | a) |
| CH0215376325 | 1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 99.00% | 821'700.00 | 0.05 | a) |
| CH0216320710 | 1.2500 % SEK 1 1/4 07/17/23 EMTN | 610 | 0 | 0 | 610 CHF | 99.96% | 609'756.00 | 0.04 | a) |
| CH0217579785 | 1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47 | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 99.65% | 807'165.00 | 0.05 | a) |
| CH0217756656 | 1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584 | 2'350 | 0 | 0 | 2'350 CHF | 99.65% | 2'341'775.00 | 0.14 | a) |
| CH0217825311 | 1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28 | 770 | 200 | 0 | 970 CHF | 99.70% | 967'090.00 | 0.06 | a) |
| CH0217825337 | 2.0000 % STGALN 2 07/16/38 | 260 | 300 | 0 | 560 CHF | 100.90% | 565'040.00 | 0.03 | a) |
| CH0217850699 | 2.0000 % ZURICH 2 07/29/38 | 770 | 0 | 0 | 770 CHF | 100.90% | 776'930.00 | 0.05 | a) |
| CH0221999813 | 1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 99.75% | 798'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0222000413 | 2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33 | 100 | 400 | 0 | 500 CHF | 101.60% | 508'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0222050921 | 2.0000 % GENEVA 2 03/20/26 | 560 | 200 | 0 | 760 CHF | 100.45% | 763'420.00 | 0.05 | a) |
| CH0222050939 | 2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29 | 1'690 | 0 | 0 | 1'690 CHF | 102.35% | 1'729'715.00 | 0.11 | a) |
| CH0222261494 | 1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 99.60% | 826'680.00 | 0.05 | a) |
| CH0223643260 | 2.1250 % BERCTY 2 1/8 10/11/38 | 100 | 0 | 0 | 100 CHF | 101.80% | 101'800.00 | 0.01 | a) |
| CH0224396983 | 1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26 | 9'990 | 3'125 | 0 | 13'115 CHF | 99.71% | 13'076'966.50 | 0.80 | a) |
| CH0224397007 | 2.0000 % SWISS 2 06/25/64 | 6'230 | 5'200 | 0 | 11'430 CHF | 118.52% | 13'546'836.00 | 0.83 | a) |
| CH0224397171 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 | 8'750 | 3'500 | 0 | 12'250 CHF | 93.88% | 11'500'300.00 | 0.71 | a) |
| CH0224397338 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 | 4'590 | 2'800 | 0 | 7'390 CHF | 74.12% | 5'477'468.00 | 0.34 | a) |
| CH0224397346 | 0.0000 % SWISS 0 06/22/29 | 10'928 | 4'500 | 0 | 15'428 CHF | 91.88% | 14'175'246.40 | 0.87 | a) |
| CH0224485927 | 2.0000 % VAUD 2 10/24/33 | 1'520 | 400 | 0 | 1'920 CHF | 101.20% | 1'943'040.00 | 0.12 | a) |
| CH0224581824 | 2.0000 % LUCERN 2 10/28/33 | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 100.90% | 252'250.00 | 0.02 | a) |
| CH0224761533 | 1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23 | 890 | 0 | 0 | 890 CHF | 99.85% | 888'620.50 | 0.05 | a) |
| CH0224923513 | 1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 99.30% | 397'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0225173332 | 2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 99.96% | 809'676.00 | 0.05 | a) |
| CH0226869060 | 1.3750 % TESSIN 1 3/8 11/21/22 | 280 | 0 | 280 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0227678973 | 1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23 | 330 | 0 | 0 | 330 CHF | 99.73% | 329'102.40 | 0.02 | a) |
| CH0227976492 | 1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24 | 2'015 | 0 | 0 | 2'015 CHF | 99.40% | 2'002'910.00 | 0.12 | a) |
| CH0228531460 | 2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43 | 100 | 0 | 0 | 100 CHF | 100.45% | 100'450.00 | 0.01 | a) |
| CH0228622392 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 100.33% | 300'990.00 | 0.02 | a) |
| CH0228674930 | 2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38 | 500 | 250 | 0 | 750 CHF | 103.50% | 776'250.00 | 0.05 | a) |
| CH0229571770 | 1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/12/22 442 | 1'110 | 0 | 1'110 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0229881153 | 2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39 | 170 | 300 | 0 | 470 CHF | 102.00% | 479'400.00 | 0.03 | a) |
| CH0233004172 | 1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25 | 1'310 | 0 | 0 | 1'310 CHF | 99.90% | 1'308'690.00 | 0.08 | a) |
| CH0233911988 | 1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN | 610 | 0 | 0 | 610 CHF | 99.70% | 608'170.00 | 0.04 | a) |
| CH0234789193 | 1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 99.65% | 199'300.00 | 0.01 | a) |
| CH0235475354 | 1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445 | 1'220 | 1'500 | 0 | 2'720 CHF | 99.17% | 2'697'424.00 | 0.17 | a) |
| CH0236516784 | 1.1250 % ZURCTY 1 1/8 03/06/23 | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 100.00% | 1'000'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0236516834 | 1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29 | 200 | 150 | 0 | 350 CHF | 99.45% | 348'075.00 | 0.02 | a) |
| CH0236669591 | 1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24 | 250 | 500 | 0 | 750 CHF | 99.57% | 746'775.00 | 0.05 | a) |
| CH0236803992 | 1.0000 % COE 1 03/06/23 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 100.00% | 500'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0237649964 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589 | 940 | 0 | 0 | 940 CHF | 100.93% | 948'742.00 | 0.06 | a) |
| CH0238315664 | 2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0238765116 | 1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 99.10% | 683'790.00 | 0.04 | a) |
| CH0239713297 | 1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 99.49% | 497'450.00 | 0.03 | a) |
| CH0239840124 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591 | 1'780 | 500 | 0 | 2'280 CHF | 99.16% | 2'260'848.00 | 0.14 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0240109618 | 1.8750 % GZOWITZ 1 7/8 06/12/24 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0241528741 | 1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN | 1'030 | 200 | 0 | 1'230 CHF | 99.50% | 1'223'850.00 | 0.08 | a) |
| CH0241926317 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593 | 1'830 | 0 | 0 | 1'830 CHF | 98.92% | 1'810'236.00 | 0.11 | a) |
| CH0242596143 | 1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449 | 1'220 | 0 | 1'220 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0243273759 | 1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 99.01% | 990'100.00 | 0.06 | a) |
| CH0244717978 | 1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0244975063 | 1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29 | 150 | 250 | 0 | 400 CHF | 96.80% | 387'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0245146185 | 1.0000 % KBAARG 1 06/19/23 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 99.84% | 559'104.00 | 0.03 | a) |
| CH0245863987 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450 | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 97.36% | 1'217'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0247754382 | 1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 98.60% | 493'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0247849992 | 1.0000 % PSHYPO 1 03/21/23 595 | 1'780 | 0 | 1'780 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0248166669 | 0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 98.86% | 741'450.00 | 0.05 | a) |
| CH0248209642 | 1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 99.43% | 497'150.00 | 0.03 | a) |
| CH0249088136 | 1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596 | 2'690 | 100 | 0 | 2'790 CHF | 98.97% | 2'761'263.00 | 0.17 | a) |
| CH0249483659 | 1.0000 % GENEVA 1 09/29/26 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 97.20% | 699'840.00 | 0.04 | a) |
| CH0251885791 | 0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 98.45% | 295'350.00 | 0.02 | a) |
| CH0252510414 | 1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 95.60% | 745'680.00 | 0.05 | a) |
| CH0252511925 | 0.8750 % LANSBK 0 7/8 09/16/24 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 98.40% | 492'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0252903726 | 1.0000 % KTBL 1 03/30/27 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 96.95% | 756'210.00 | 0.05 | a) |
| CH0252903767 | 1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34 | 1'000 | 700 | 0 | 1'700 CHF | 94.70% | 1'609'900.00 | 0.10 | a) |
| CH0253225954 | 0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0253243353 | 1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50 | 550 | 0 | 0 | 550 CHF | 95.60% | 525'800.00 | 0.03 | a) |
| CH0253609231 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454 | 1'300 | 0 | 0 | 1'300 CHF | 98.79% | 1'284'270.00 | 0.08 | a) |
| CH0253612581 | 1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 97.00% | 194'000.00 | 0.01 | a) |
| CH0253612763 | 1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 95.85% | 795'555.00 | 0.05 | a) |
| CH0254212233 | 1.0000 % ZURICH 1 10/06/27 | 1'670 | 0 | 0 | 1'670 CHF | 96.55% | 1'612'385.00 | 0.10 | a) |
| CH0254849513 | 0.6250 % ZUGKAN 0 5/8 10/17/22 | 0 | 100 | 100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0255678333 | 1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598 | 400 | 900 | 0 | 1'300 CHF | 97.09% | 1'262'170.00 | 0.08 | a) |
| CH0255678341 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599 | 0 | 1'300 | 0 | 1'300 CHF | 93.90% | 1'220'700.00 | 0.08 | a) |
| CH0255893072 | 0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 94.30% | 282'900.00 | 0.02 | a) |
| CH0256434603 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456 | 2'220 | 0 | 0 | 2'220 CHF | 98.26% | 2'181'372.00 | 0.13 | a) |
| CH0258586384 | 0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600 | 1'350 | 2'100 | 0 | 3'450 CHF | 98.34% | 3'392'730.00 | 0.21 | a) |
| CH0258586392 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601 | 300 | 250 | 0 | 550 CHF | 93.35% | 513'425.00 | 0.03 | a) |
| CH0260067779 | 1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 93.60% | 645'840.00 | 0.04 | a) |
| CH0260515769 | 0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 97.95% | 195'900.00 | 0.01 | a) |
| CH0260769440 | 1.8750 % T 1 7/8 12/04/30 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0261541863 | 0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24 | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 98.25% | 795'825.00 | 0.05 | a) |
| CH0261561382 | 0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24 | 330 | 500 | 0 | 830 CHF | 97.75% | 811'325.00 | 0.05 | a) |
| CH0261627415 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602 | 1'080 | 500 | 0 | 1'580 CHF | 91.05% | 1'438'590.00 | 0.09 | a) |
| CH0262085076 | 0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30 | 1'350 | 0 | 0 | 1'350 CHF | 92.30% | 1'246'050.00 | 0.08 | a) |
| CH0262286252 | 0.6250 % WKBNSW 0 5/8 12/15/23 | 300 | 0 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0263432970 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458 | 2'780 | 0 | 0 | 2'780 CHF | 99.30% | 2'760'540.00 | 0.17 | a) |
| CH0263432988 | 1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459 | 4'430 | 850 | 0 | 5'280 CHF | 95.00% | 5'016'000.00 | 0.31 | a) |
| CH0264227015 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603 | 3'220 | 0 | 0 | 3'220 CHF | 97.52% | 3'140'144.00 | 0.19 | a) |
| CH0265801198 | 0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25 | 1'170 | 0 | 0 | 1'170 CHF | 97.20% | 1'137'240.00 | 0.07 | a) |
| CH0266307377 | 0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 89.55% | 599'985.00 | 0.04 | a) |
| CH0267222310 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604 | 2'780 | 300 | 0 | 3'080 CHF | 89.62% | 2'760'296.00 | 0.17 | a) |
| CH0267855986 | 0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26 | 600 | 0 | 0 | 600 CHF | 95.45% | 572'700.00 | 0.04 | a) |
| CH0267855994 | 0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36 | 450 | 0 | 0 | 450 CHF | 84.90% | 382'050.00 | 0.02 | a) |
| CH0267856000 | 0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 96.55% | 193'100.00 | 0.01 | a) |
| CH0268100226 | 0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35 | 860 | 0 | 0 | 860 CHF | 84.60% | 727'560.00 | 0.04 | a) |
| CH0268786982 | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460 | 2'700 | 0 | 0 | 2'700 CHF | 91.20% | 2'462'400.00 | 0.15 | a) |
| CH0269697931 | 0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 93.85% | 675'720.00 | 0.04 | a) |
| CH0269699176 | 0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27 | 250 | 0 | 250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0269796212 | 0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 91.25% | 711'750.00 | 0.04 | a) |
| CH0270017830 | 0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27 | 1'240 | 0 | 0 | 1'240 CHF | 93.15% | 1'155'060.00 | 0.07 | a) |
| CH0270373803 | 1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45 | 690 | 1'200 | 0 | 1'890 CHF | 83.50% | 1'578'150.00 | 0.10 | a) |
| CH0270382093 | 0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN | 1'240 | 0 | 0 | 1'240 CHF | 94.35% | 1'169'940.00 | 0.07 | a) |
| CH0270586206 | 0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 90.40% | 605'680.00 | 0.04 | a) |
| CH0271288547 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605 | 2'890 | 500 | 0 | 3'390 CHF | 92.90% | 3'149'310.00 | 0.19 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0271288554 | 0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606 | 0 | 1'500 | 0 | 1'500 CHF | 86.98% | 1'304'700.00 | 0.08 | a) |
| CH0271737097 | 0.6250 % BCJZSW 0 5/8 03/04/25 | 200 | 200 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0271819812 | 0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27 | 640 | 0 | 0 | 640 CHF | 94.15% | 602'560.00 | 0.04 | a) |
| CH0272154177 | 1.0000 % KTBL 1 03/05/40 | 280 | 700 | 0 | 980 CHF | 86.05% | 843'290.00 | 0.05 | a) |
| CH0273037892 | 0.2500 % WKBSNW 0 1/4 03/16/23 | 450 | 0 | 450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0273485380 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461 | 2'280 | 0 | 0 | 2'280 CHF | 97.10% | 2'213'880.00 | 0.14 | a) |
| CH0273485398 | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462 | 3'750 | 0 | 0 | 3'750 CHF | 91.90% | 3'446'250.00 | 0.21 | a) |
| CH0274253514 | 0.6000 % KBFRI 0.6 04/09/27 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 94.30% | 471'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0274314787 | 0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28 | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 93.85% | 1'173'125.00 | 0.07 | a) |
| CH0275352125 | 0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25 | 600 | 200 | 0 | 800 CHF | 96.70% | 773'600.00 | 0.05 | a) |
| CH0275527882 | 0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28 | 500 | 200 | 0 | 700 CHF | 93.20% | 652'400.00 | 0.04 | a) |
| CH0276423818 | 0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29 | 550 | 250 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0276801476 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 86.70% | 2'306'220.00 | 0.14 | a) |
| CH0278346769 | 0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 96.30% | 385'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0278667107 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463 | 2'520 | 0 | 0 | 2'520 CHF | 98.40% | 2'479'680.00 | 0.15 | a) |
| CH0278667115 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464 | 2'330 | 0 | 0 | 2'330 CHF | 90.12% | 2'099'796.00 | 0.13 | a) |
| CH0279720343 | 0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 96.25% | 481'250.00 | 0.03 | a) |
| CH0280063493 | 0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 86.30% | 716'290.00 | 0.04 | a) |
| CH0280569093 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609 | 1'830 | 0 | 0 | 1'830 CHF | 98.83% | 1'808'589.00 | 0.11 | a) |
| CH0280569135 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610 | 750 | 1'300 | 0 | 2'050 CHF | 85.78% | 1'758'490.00 | 0.11 | a) |
| CH0280737518 | 0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 96.25% | 539'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0280737542 | 0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 90.10% | 648'720.00 | 0.04 | a) |
| CH0281835485 | 0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25 | 600 | 200 | 0 | 800 CHF | 96.80% | 774'400.00 | 0.05 | a) |
| CH0282019006 | 1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0282528899 | 0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611 | 2'220 | 0 | 0 | 2'220 CHF | 84.85% | 1'883'670.00 | 0.12 | a) |
| CH0282528907 | 1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612 | 1'550 | 0 | 0 | 1'550 CHF | 81.56% | 1'264'180.00 | 0.08 | a) |
| CH0282857868 | 0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 98.08% | 706'176.00 | 0.04 | a) |
| CH0282857876 | 0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32 | 710 | 0 | 0 | 710 CHF | 90.30% | 641'130.00 | 0.04 | a) |
| CH0283727367 | 0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24 | 0 | 450 | 0 | 450 CHF | 97.90% | 440'550.00 | 0.03 | a) |
| CH0284687404 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613 | 1'000 | 2'100 | 0 | 3'100 CHF | 97.41% | 3'019'710.00 | 0.19 | a) |
| CH0284687412 | 1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 91.12% | 1'457'920.00 | 0.09 | a) |
| CH0284687420 | 1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615 | 1'220 | 0 | 0 | 1'220 CHF | 84.64% | 1'032'608.00 | 0.06 | a) |
| CH0284915896 | 0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 96.85% | 484'250.00 | 0.03 | a) |
| CH0284950505 | 1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40 | 610 | 0 | 0 | 610 CHF | 87.30% | 532'530.00 | 0.03 | a) |
| CH0285597370 | 0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN | 560 | 200 | 0 | 760 CHF | 95.00% | 722'000.00 | 0.04 | a) |
| CH0285849367 | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466 | 2'220 | 0 | 0 | 2'220 CHF | 94.60% | 2'100'120.00 | 0.13 | a) |
| CH0288286385 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467 | 1'700 | 900 | 0 | 2'600 CHF | 96.82% | 2'517'320.00 | 0.15 | a) |
| CH0290007134 | 0.3750 % KBBS 0 3/8 08/10/23 | 1'360 | 0 | 0 | 1'360 CHF | 99.49% | 1'353'064.00 | 0.08 | a) |
| CH0290876512 | 0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 96.85% | 484'250.00 | 0.03 | a) |
| CH0291625231 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 95.72% | 287'160.00 | 0.02 | a) |
| CH0292365084 | 0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 87.65% | 262'950.00 | 0.02 | a) |
| CH0293026222 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617 | 1'550 | 1'550 | 0 | 3'100 CHF | 89.40% | 2'771'400.00 | 0.17 | a) |
| CH0293343411 | 0.4000 % WKBSNW 0.4 09/15/25 | 750 | 0 | 750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0295186388 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469 | 2'780 | 0 | 0 | 2'780 CHF | 96.25% | 2'675'750.00 | 0.16 | a) |
| CH0296231951 | 0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23 | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 99.34% | 993'400.00 | 0.06 | a) |
| CH0297132349 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618 | 5'660 | 0 | 0 | 5'660 CHF | 96.18% | 5'443'788.00 | 0.33 | a) |
| CH0297132364 | 1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619 | 800 | 450 | 0 | 1'250 CHF | 87.53% | 1'094'125.00 | 0.07 | a) |
| CH0297343557 | 0.0000 % SOLEUR 0 10/16/23 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 99.09% | 386'435.40 | 0.02 | a) |
| CH0297343565 | 0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30 | 770 | 0 | 0 | 770 CHF | 90.25% | 694'925.00 | 0.04 | a) |
| CH0297974898 | 1.0000 % KO 1 10/02/28 | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0299297280 | 0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135 | 1'280 | 0 | 0 | 1'280 CHF | 90.45% | 1'157'760.00 | 0.07 | a) |
| CH0300417273 | 0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 96.95% | 378'105.00 | 0.02 | a) |
| CH0300874267 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470 | 2'460 | 450 | 0 | 2'910 CHF | 97.70% | 2'843'070.00 | 0.17 | a) |
| CH0300874283 | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471 | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 90.15% | 1'983'300.00 | 0.12 | a) |
| CH0301549348 | 0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN | 500 | 250 | 0 | 750 CHF | 95.70% | 717'750.00 | 0.04 | a) |
| CH0302424392 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621 | 3'000 | 0 | 0 | 3'000 CHF | 91.28% | 2'738'400.00 | 0.17 | a) |
| CH0302790131 | 0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 96.95% | 649'565.00 | 0.04 | a) |
| CH0303196148 | 0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27 | 560 | 700 | 0 | 1'260 CHF | 93.05% | 1'172'430.00 | 0.07 | a) |
| CH0304755157 | 0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623 | 2'280 | 0 | 0 | 2'280 CHF | 85.98% | 1'960'344.00 | 0.12 | a) |
| CH0304966960 | 0.0500 % KBAARG 0.05 12/16/22 | 780 | 0 | 780 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0305186535 | 0.0400 % ZKB 0.04 12/09/22 136 | 330 | 0 | 330 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0305398247 | 0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN | 100 | 800 | 0 | 900 CHF | 94.55% | 850'950.00 | 0.05 a) | |
| CH0305398254 | 0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN | 890 | 100 | 0 | 990 CHF | 95.00% | 940'500.00 | 0.06 a) | |
| CH0305765775 | 0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 92.25% | 461'250.00 | 0.03 a) | |
| CH0305954569 | 0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 90.00% | 180'000.00 | 0.01 a) | |
| CH0306173722 | 0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 472 | 2'440 | 0 | 0 | 2'440 CHF | 99.43% | 2'426'092.00 | 0.15 a) | |
| CH0306173730 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473 | 2'110 | 0 | 0 | 2'110 CHF | 94.89% | 2'002'179.00 | 0.12 a) | |
| CH0306173748 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474 | 2'220 | 1'300 | 0 | 3'520 CHF | 89.40% | 3'146'880.00 | 0.19 a) | |
| CH0307256419 | 0.0000 % SCHWYZ 0 01/20/23 | 390 | 0 | 390 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0307256427 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475 | 1'700 | 1'000 | 0 | 2'700 CHF | 92.25% | 2'490'750.00 | 0.15 a) | |
| CH0307256450 | 0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476 | 2'660 | 950 | 0 | 3'610 CHF | 83.20% | 3'003'520.00 | 0.18 a) | |
| CH0310175564 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625 | 3'250 | 0 | 0 | 3'250 CHF | 94.55% | 3'072'875.00 | 0.19 a) | |
| CH0310175598 | 0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 94.80% | 474'000.00 | 0.03 a) | |
| CH0310646523 | 0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 92.55% | 666'360.00 | 0.04 a) | |
| CH0311427618 | 0.2000 % WKBSW 0.2 08/19/24 | 750 | 0 | 750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0312512640 | 0.2500 % GRKPSW 0 1/4 03/10/28 | 600 | 250 | 850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0312512715 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478 | 2'520 | 500 | 0 | 3'020 CHF | 84.30% | 2'545'860.00 | 0.16 a) | |
| CH0312512731 | 0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 81.05% | 583'560.00 | 0.04 a) | |
| CH0313130061 | 0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26 | 280 | 0 | 0 | 280 CHF | 94.90% | 265'720.00 | 0.02 a) | |
| CH0315593860 | 0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0315593928 | 0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36 | 890 | 250 | 0 | 1'140 CHF | 81.55% | 929'670.00 | 0.06 a) | |
| CH031595903 | 0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 97.05% | 242'625.00 | 0.01 a) | |
| CH0319403744 | 0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480 | 2'330 | 0 | 0 | 2'330 CHF | 93.48% | 2'178'084.00 | 0.13 a) | |
| CH0319403751 | 0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138 | 500 | 400 | 0 | 900 CHF | 94.25% | 848'250.00 | 0.05 a) | |
| CH0319403769 | 0.2500 % NIDKKB 0 1/4 05/27/26 | 700 | 0 | 0 | 700 CHF | 94.60% | 662'200.00 | 0.04 a) | |
| CH0319403785 | 0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481 | 3'110 | 0 | 0 | 3'110 CHF | 86.84% | 2'700'724.00 | 0.17 a) | |
| CH0319415920 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627 | 2'640 | 0 | 0 | 2'640 CHF | 90.46% | 2'388'144.00 | 0.15 a) | |
| CH0319415938 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628 | 1'830 | 0 | 0 | 1'830 CHF | 86.55% | 1'583'865.00 | 0.10 a) | |
| CH0319415946 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629 | 2'890 | 0 | 0 | 2'890 CHF | 82.30% | 2'378'470.00 | 0.15 a) | |
| CH0319416126 | 0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 93.20% | 186'400.00 | 0.01 a) | |
| CH0319416134 | 0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36 | 440 | 500 | 0 | 940 CHF | 83.05% | 780'670.00 | 0.05 a) | |
| CH0323604188 | 0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 86.80% | 651'000.00 | 0.04 a) | |
| CH0323735628 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631 | 2'490 | 0 | 0 | 2'490 CHF | 91.74% | 2'284'326.00 | 0.14 a) | |
| CH0326213912 | 0.2500 % KISPZ 0 1/4 07/28/28 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0326213920 | 0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46 | 1'110 | 500 | 0 | 1'610 CHF | 74.40% | 1'197'840.00 | 0.07 a) | |
| CH0326371470 | 0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 91.00% | 591'500.00 | 0.04 a) | |
| CH0328298069 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632 | 2'640 | 0 | 0 | 2'640 CHF | 76.00% | 2'006'400.00 | 0.12 a) | |
| CH0328599235 | 0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25 | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 95.80% | 958'000.00 | 0.06 a) | |
| CH0328901100 | 0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44 | 670 | 400 | 0 | 1'070 CHF | 71.80% | 768'260.00 | 0.05 a) | |
| CH0330143188 | 0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139 | 1'200 | 200 | 0 | 1'400 CHF | 91.60% | 1'282'400.00 | 0.08 a) | |
| CH0330938835 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633 | 1'110 | 1'350 | 0 | 2'460 CHF | 75.52% | 1'857'792.00 | 0.11 a) | |
| CH0330938892 | 0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 95.60% | 372'840.00 | 0.02 a) | |
| CH0330938900 | 0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 85.55% | 427'750.00 | 0.03 a) | |
| CH0331455326 | 0.0000 % KTBS 0 09/05/23 | 330 | 0 | 0 | 330 CHF | 99.27% | 327'574.50 | 0.02 a) | |
| CH0331455334 | 0.0000 % KTBS 0 09/04/26 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 93.80% | 375'200.00 | 0.02 a) | |
| CH0331455342 | 0.0000 % KTBS 0 09/05/29 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 89.90% | 503'440.00 | 0.03 a) | |
| CH0336352742 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 85.31% | 767'790.00 | 0.05 a) | |
| CH0336352759 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636 | 1'550 | 0 | 0 | 1'550 CHF | 73.29% | 1'135'995.00 | 0.07 a) | |
| CH0336352767 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637 | 1'390 | 1'000 | 0 | 2'390 CHF | 69.05% | 1'650'295.00 | 0.10 a) | |
| CH0336352817 | 0.0400 % NIDOE 0.04 10/23/26 | 280 | 0 | 0 | 280 CHF | 94.10% | 263'480.00 | 0.02 a) | |
| CH0336587644 | 0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 96.95% | 649'565.00 | 0.04 a) | |
| CH0336587669 | 0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482 | 2'390 | 0 | 0 | 2'390 CHF | 97.99% | 2'341'961.00 | 0.14 a) | |
| CH0336587719 | 0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483 | 2'890 | 100 | 0 | 2'990 CHF | 92.92% | 2'778'308.00 | 0.17 a) | |
| CH0336587727 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484 | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 85.09% | 1'531'620.00 | 0.09 a) | |
| CH0338330415 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639 | 500 | 1'150 | 0 | 1'650 CHF | 83.20% | 1'372'800.00 | 0.08 a) | |
| CH0338330423 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640 | 2'110 | 350 | 0 | 2'460 CHF | 72.04% | 1'772'184.00 | 0.11 a) | |
| CH0338330456 | 0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN | 0 | 200 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0338330472 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 78.15% | 2'078'790.00 | 0.13 a) | |
| CH0340907929 | 0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28 | 1'060 | 0 | 0 | 1'060 CHF | 89.50% | 948'700.00 | 0.06 a) | |
| CH0341440318 | 0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 71.15% | 476'705.00 | 0.03 a) | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0341725916 | 0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56 | 500 | 500 | 0 | 1'000 CHF | 64.25% | 642'500.00 | 0.04 | a) |
| CH0342587638 | 0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140 | 910 | 0 | 0 | 910 CHF | 93.10% | 847'210.00 | 0.05 | a) |
| CH0342587646 | 0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41 | 430 | 500 | 0 | 930 CHF | 73.65% | 684'945.00 | 0.04 | a) |
| CH0343366792 | 0.0500 % BERN 0.05 11/18/31 | 1'230 | 0 | 0 | 1'230 CHF | 84.85% | 1'043'655.00 | 0.06 | a) |
| CH0344583791 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488 | 2'790 | 0 | 0 | 2'790 CHF | 96.44% | 2'690'676.00 | 0.17 | a) |
| CH0344583809 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486 | 3'130 | 0 | 0 | 3'130 CHF | 96.96% | 3'034'848.00 | 0.19 | a) |
| CH0344583817 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487 | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 91.55% | 2'014'100.00 | 0.12 | a) |
| CH0344583833 | 0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 87.95% | 439'750.00 | 0.03 | a) |
| CH0344583866 | 0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26 | 200 | 450 | 0 | 650 CHF | 93.10% | 605'150.00 | 0.04 | a) |
| CH0344958472 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 | 3'530 | 3'700 | 0 | 7'230 CHF | 75.63% | 5'468'049.00 | 0.34 | a) |
| CH0344958498 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45 | 5'730 | 5'750 | 0 | 11'480 CHF | 81.75% | 9'384'900.00 | 0.58 | a) |
| CH0344958688 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 | 6'390 | 4'200 | 0 | 10'590 CHF | 91.69% | 9'709'971.00 | 0.60 | a) |
| CH0347082783 | 0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141 | 1'780 | 0 | 0 | 1'780 CHF | 95.10% | 1'692'780.00 | 0.10 | a) |
| CH0347082809 | 0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27 | 670 | 150 | 0 | 820 CHF | 93.25% | 764'650.00 | 0.05 | a) |
| CH0347556885 | 0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN | 500 | 400 | 0 | 900 CHF | 94.40% | 849'600.00 | 0.05 | a) |
| CH0347556901 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643 | 2'440 | 1'000 | 0 | 3'440 CHF | 96.25% | 3'311'000.00 | 0.20 | a) |
| CH0347556927 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645 | 0 | 1'100 | 0 | 1'100 CHF | 82.25% | 904'750.00 | 0.06 | a) |
| CH0352595851 | 0.2000 % WKBSNW 0.2 02/02/26 | 500 | 0 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0352595885 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489 | 1'250 | 1'500 | 0 | 2'750 CHF | 93.28% | 2'565'200.00 | 0.16 | a) |
| CH0352595893 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490 | 300 | 1'500 | 0 | 1'800 CHF | 87.27% | 1'570'860.00 | 0.10 | a) |
| CH0353105197 | 0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 92.20% | 599'300.00 | 0.04 | a) |
| CH0353428037 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 90.50% | 905'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0353428052 | 0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31 | 1'110 | 0 | 0 | 1'110 CHF | 89.00% | 987'900.00 | 0.06 | a) |
| CH0353574319 | 0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27 | 1'610 | 0 | 0 | 1'610 CHF | 92.95% | 1'496'495.00 | 0.09 | a) |
| CH0353574327 | 0.0000 % KTBS 0 11/22/24 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 96.95% | 649'565.00 | 0.04 | a) |
| CH0353945378 | 0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 94.50% | 378'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0357483194 | 0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26 | 810 | 0 | 0 | 810 CHF | 94.35% | 764'235.00 | 0.05 | a) |
| CH0357676151 | 0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491 | 2'530 | 0 | 0 | 2'530 CHF | 98.40% | 2'489'520.00 | 0.15 | a) |
| CH0357676169 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492 | 2'720 | 300 | 0 | 3'020 CHF | 94.48% | 2'853'296.00 | 0.18 | a) |
| CH0357676177 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493 | 3'890 | 850 | 0 | 4'740 CHF | 91.00% | 4'313'400.00 | 0.27 | a) |
| CH0358654942 | 0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 81.50% | 489'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0358654975 | 0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024 | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0360172727 | 0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 95.85% | 718'875.00 | 0.04 | a) |
| CH0360172768 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647 | 3'210 | 500 | 0 | 3'710 CHF | 93.80% | 3'479'980.00 | 0.21 | a) |
| CH0361532820 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494 | 3'550 | 0 | 0 | 3'550 CHF | 93.28% | 3'311'440.00 | 0.20 | a) |
| CH0361532911 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495 | 2'220 | 0 | 0 | 2'220 CHF | 94.92% | 2'107'224.00 | 0.13 | a) |
| CH0361532960 | 0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 87.15% | 435'750.00 | 0.03 | a) |
| CH0361533067 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496 | 1'670 | 700 | 0 | 2'370 CHF | 95.72% | 2'268'564.00 | 0.14 | a) |
| CH0361533117 | 0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN | 760 | 0 | 0 | 760 CHF | 83.25% | 632'700.00 | 0.04 | a) |
| CH0361533125 | 0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 82.60% | 520'380.00 | 0.03 | a) |
| CH0361533166 | 0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 85.00% | 637'500.00 | 0.04 | a) |
| CH0361533174 | 0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27 | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 92.70% | 584'010.00 | 0.04 | a) |
| CH0361533232 | 0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 77.70% | 435'120.00 | 0.03 | a) |
| CH0362748276 | 0.2000 % NADB 0.2 10/26/27 | 250 | 300 | 0 | 550 CHF | 91.95% | 505'725.00 | 0.03 | a) |
| CH0362748292 | 0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 82.20% | 246'600.00 | 0.02 | a) |
| CH0362748326 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 98.22% | 2'612'652.00 | 0.16 | a) |
| CH0362748342 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649 | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 84.45% | 1'520'100.00 | 0.09 | a) |
| CH0364277415 | 0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39 | 440 | 200 | 0 | 640 CHF | 80.85% | 517'440.00 | 0.03 | a) |
| CH0365501508 | 0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN | 0 | 900 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0367206700 | 1.0000 % GALESW 1 12/15/26 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0368172877 | 0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27 | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 92.30% | 738'400.00 | 0.05 | a) |
| CH0368306871 | 0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29 | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 89.90% | 224'750.00 | 0.01 | a) |
| CH0370634633 | 0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 95.20% | 790'160.00 | 0.05 | a) |
| CH0370943539 | 0.0000 % PSHYPO 0 11/22/22 650 | 2'050 | 0 | 2'050 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0370943547 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651 | 700 | 1'000 | 0 | 1'700 CHF | 94.22% | 1'601'740.00 | 0.10 | a) |
| CH0370943554 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 79.20% | 396'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0373476073 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497 | 500 | 1'800 | 0 | 2'300 CHF | 92.01% | 2'116'230.00 | 0.13 | a) |
| CH0373476198 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498 | 2'410 | 1'000 | 0 | 3'410 CHF | 92.45% | 3'152'545.00 | 0.19 | a) |
| CH0373476214 | 0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24 | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476263 | 0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 86.05% | 430'250.00 | 0.03 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0373476339 | 0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142 | 1'220 | 0 | 0 | 1'220 CHF | 91.95% | 1'121'790.00 | 0.07 | a) |
| CH0373476370 | 0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35 | 2'700 | 0 | 280 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476412 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499 | 2'700 | 300 | 0 | 3'000 CHF | 92.85% | 2'785'500.00 | 0.17 | a) |
| CH0373476420 | 0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500 | 1'780 | 0 | 0 | 1'780 CHF | 87.20% | 1'552'160.00 | 0.10 | a) |
| CH0373476438 | 0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26 | 400 | 0 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476636 | 1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476677 | 0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 96.35% | 385'400.00 | 0.02 | a) |
| CH0373476693 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501 | 3'050 | 450 | 0 | 3'500 CHF | 92.09% | 3'223'150.00 | 0.20 | a) |
| CH0373476727 | 0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 89.45% | 348'855.00 | 0.02 | a) |
| CH0373476776 | 0.1250 % GRKPSW 0 1/8 05/29/24 | 800 | 0 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476784 | 0.5000 % KBBSH 0 1/2 05/31/28 | 300 | 250 | 0 | 550 CHF | 92.35% | 507'925.00 | 0.03 | a) |
| CH0373476933 | 0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 96.50% | 800'950.00 | 0.05 | a) |
| CH0373476966 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502 | 1'440 | 0 | 0 | 1'440 CHF | 87.65% | 1'262'160.00 | 0.08 | a) |
| CH0373476974 | 1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373945036 | 0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN | 400 | 200 | 0 | 600 CHF | 92.80% | 556'800.00 | 0.03 | a) |
| CH0373945044 | 0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN | 690 | 250 | 0 | 940 CHF | 94.85% | 891'590.00 | 0.05 | a) |
| CH0373945085 | 0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN | 1'080 | 0 | 0 | 1'080 CHF | 89.75% | 969'300.00 | 0.06 | a) |
| CH0373945093 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653 | 3'530 | 0 | 0 | 3'530 CHF | 92.59% | 3'268'427.00 | 0.20 | a) |
| CH0379268755 | 0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 95.30% | 190'600.00 | 0.01 | a) |
| CH0379354225 | 0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0 | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 94.10% | 752'800.00 | 0.05 | a) |
| CH0379610980 | 0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 81.45% | 456'120.00 | 0.03 | a) |
| CH0380011574 | 0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37 | 360 | 0 | 0 | 360 CHF | 82.35% | 296'460.00 | 0.02 | a) |
| CH0384125065 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 94.43% | 2'511'838.00 | 0.15 | a) |
| CH0384125073 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655 | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 90.17% | 1'127'125.00 | 0.07 | a) |
| CH0384125081 | 0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656 | 850 | 0 | 0 | 850 CHF | 81.87% | 695'895.00 | 0.04 | a) |
| CH0385518045 | 0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0386949314 | 0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN | 740 | 0 | 0 | 740 CHF | 86.35% | 638'990.00 | 0.04 | a) |
| CH0386949348 | 0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 92.80% | 742'400.00 | 0.05 | a) |
| CH0387879031 | 0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 93.05% | 521'080.00 | 0.03 | a) |
| CH0387879049 | 0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31 | 1'000 | 400 | 0 | 1'400 CHF | 88.75% | 1'242'500.00 | 0.08 | a) |
| CH0387879072 | 0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25 | 940 | 0 | 0 | 940 CHF | 96.00% | 902'400.00 | 0.06 | a) |
| CH0387879080 | 0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27 | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 92.25% | 581'175.00 | 0.04 | a) |
| CH0392885734 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657 | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 94.98% | 949'800.00 | 0.06 | a) |
| CH0392885809 | 0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28 | 670 | 0 | 0 | 670 CHF | 91.55% | 613'385.00 | 0.04 | a) |
| CH0394905712 | 0.0000 % KTBS 0 09/24/25 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 95.65% | 535'640.00 | 0.03 | a) |
| CH0397450724 | 0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 93.40% | 934'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0398633252 | 1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633260 | 0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24 | 500 | 0 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633278 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503 | 1'400 | 0 | 0 | 1'400 CHF | 96.33% | 1'348'620.00 | 0.08 | a) |
| CH0398633336 | 0.3500 % WKBNSW 0.35 09/07/27 | 300 | 200 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633344 | 0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633369 | 0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26 | 580 | 0 | 0 | 580 CHF | 93.95% | 544'910.00 | 0.03 | a) |
| CH0398633377 | 0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633443 | 0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28 | 0 | 200 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633492 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505 | 2'220 | 400 | 0 | 2'620 CHF | 88.59% | 2'321'058.00 | 0.14 | a) |
| CH0398633567 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506 | 1'400 | 0 | 0 | 1'400 CHF | 97.12% | 1'359'680.00 | 0.08 | a) |
| CH0398633575 | 0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507 | 3'220 | 100 | 0 | 3'320 CHF | 92.40% | 3'067'680.00 | 0.19 | a) |
| CH0398633591 | 0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26 | 390 | 0 | 390 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633641 | 0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 89.65% | 502'040.00 | 0.03 | a) |
| CH0398633799 | 0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144 | 550 | 0 | 0 | 550 CHF | 93.10% | 512'050.00 | 0.03 | a) |
| CH0398633922 | 0.3750 % GRKPSW 0 3/8 05/28/32 | 750 | 250 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398677671 | 0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN | 630 | 200 | 0 | 830 CHF | 75.40% | 625'820.00 | 0.04 | a) |
| CH0398913498 | 0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 94.75% | 473'750.00 | 0.03 | a) |
| CH0401007346 | 0.2530 % EIBKOR 0.253 03/06/23 EMTN | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 99.99% | 779'922.00 | 0.05 | a) |
| CH0401956823 | 1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 85.10% | 340'400.00 | 0.02 | a) |
| CH0401956872 | 0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0401956880 | 0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 95.50% | 764'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0404322205 | 0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28 | 920 | 400 | 0 | 1'320 CHF | 92.85% | 1'225'620.00 | 0.08 | a) |
| CH0405985836 | 0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0 | 500 | 200 | 0 | 700 CHF | 90.90% | 636'300.00 | 0.04 | a) |
| CH0405986057 | 0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25 | 500 | 600 | 0 | 1'100 CHF | 96.45% | 1'060'950.00 | 0.07 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0406415247 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658 | 400 | 500 | 0 | 900 CHF | 98.05% | 882'450.00 | 0.05 | a) |
| CH0406415262 | 0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 96.35% | 375'765.00 | 0.02 | a) |
| CH0406415304 | 0.2000 % LANSBK 0.2 04/17/26 EMTN | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 94.75% | 530'600.00 | 0.03 | a) |
| CH0407153359 | 0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 95.25% | 762'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0407676383 | 0.2000 % NIDKKB 0.2 03/28/25 | 280 | 400 | 0 | 680 CHF | 96.35% | 655'180.00 | 0.04 | a) |
| CH0409606347 | 0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28 | 490 | 0 | 0 | 490 CHF | 91.90% | 450'310.00 | 0.03 | a) |
| CH0413618346 | 0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN | 670 | 550 | 0 | 1'220 CHF | 96.10% | 1'172'420.00 | 0.07 | a) |
| CH0413618361 | 1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0414510062 | 0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN | 600 | 200 | 0 | 800 CHF | 96.40% | 771'200.00 | 0.05 | a) |
| CH0417086078 | 0.3030 % KDB 0.303 06/14/23 EMTN | 280 | 0 | 0 | 280 CHF | 99.58% | 278'824.00 | 0.02 | a) |
| CH0417086086 | 0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN | 1'330 | 250 | 0 | 1'580 CHF | 92.55% | 1'462'290.00 | 0.09 | a) |
| CH0419040735 | 0.3000 % WKBNSW 0.3 02/01/27 | 500 | 400 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419040776 | 0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34 | 610 | 0 | 0 | 610 CHF | 87.90% | 536'190.00 | 0.03 | a) |
| CH0419040784 | 0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 92.50% | 925'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0419040842 | 0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508 | 2'650 | 800 | 0 | 3'450 CHF | 89.30% | 3'080'850.00 | 0.19 | a) |
| CH0419040883 | 0.0000 % KTBS 0 02/22/23 | 330 | 0 | 330 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419040891 | 0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 85.90% | 257'700.00 | 0.02 | a) |
| CH0419040925 | 1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 78.65% | 393'250.00 | 0.02 | a) |
| CH0419040941 | 0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509 | 2'550 | 0 | 0 | 2'550 CHF | 90.42% | 2'305'710.00 | 0.14 | a) |
| CH0419040958 | 0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510 | 1'580 | 0 | 0 | 1'580 CHF | 81.04% | 1'280'432.00 | 0.08 | a) |
| CH0419041006 | 0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27 | 500 | 250 | 0 | 750 CHF | 92.75% | 695'625.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041071 | 0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27 | 1'670 | 0 | 0 | 1'670 CHF | 94.65% | 1'580'655.00 | 0.10 | a) |
| CH0419041089 | 1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34 | 220 | 0 | 0 | 220 CHF | 88.85% | 195'470.00 | 0.01 | a) |
| CH0419041154 | 0.3500 % BERN 0.35 05/08/34 | 860 | 0 | 0 | 860 CHF | 84.05% | 722'830.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041170 | 0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512 | 0 | 2'500 | 0 | 2'500 CHF | 89.11% | 2'227'750.00 | 0.14 | a) |
| CH0419041188 | 0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513 | 600 | 1'100 | 0 | 1'700 CHF | 84.25% | 1'432'250.00 | 0.09 | a) |
| CH0419041212 | 0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61 | 0 | 760 | 0 | 760 CHF | 81.00% | 615'600.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041238 | 0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 88.75% | 621'250.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041303 | 0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39 | 390 | 400 | 0 | 790 CHF | 75.25% | 594'475.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041311 | 0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041378 | 0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041410 | 0.0000 % KBBS 0 08/23/34 | 200 | 550 | 0 | 750 CHF | 78.05% | 585'375.00 | 0.04 | a) |
| CH0419041428 | 0.0000 % KSWINT 0 09/30/31 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041436 | 0.0000 % KBAARG 0 09/17/29 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 87.45% | 262'350.00 | 0.02 | a) |
| CH0419041469 | 0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514 | 150 | 400 | 0 | 550 CHF | 73.80% | 405'900.00 | 0.02 | a) |
| CH0419041493 | 0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041527 | 0.0000 % LLBSW 0 09/27/29 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041543 | 0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0421460400 | 0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN | 980 | 0 | 0 | 980 CHF | 97.48% | 955'304.00 | 0.06 | a) |
| CH0423233516 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659 | 5'500 | 0 | 0 | 5'500 CHF | 95.67% | 5'261'850.00 | 0.32 | a) |
| CH0423233524 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660 | 5'220 | 0 | 0 | 5'220 CHF | 91.86% | 4'795'092.00 | 0.29 | a) |
| CH0423233540 | 0.3000 % NADB 0.3 07/24/26 | 610 | 0 | 0 | 610 CHF | 94.60% | 577'060.00 | 0.04 | a) |
| CH0423233565 | 0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 98.57% | 492'850.00 | 0.03 | a) |
| CH0428194242 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661 | 3'440 | 0 | 0 | 3'440 CHF | 92.01% | 3'165'144.00 | 0.19 | a) |
| CH0428194259 | 1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662 | 1'600 | 0 | 0 | 1'600 CHF | 82.83% | 1'325'280.00 | 0.08 | a) |
| CH0429659607 | 1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0434678378 | 0.0000 % LUCERN 0 10/15/25 | 790 | 0 | 0 | 790 CHF | 95.35% | 753'265.00 | 0.05 | a) |
| CH0434678394 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663 | 400 | 1'000 | 0 | 1'400 CHF | 92.94% | 1'301'160.00 | 0.08 | a) |
| CH0434678436 | 1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37 | 280 | 0 | 0 | 280 CHF | 87.00% | 243'600.00 | 0.01 | a) |
| CH0435590382 | 0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN | 900 | 200 | 0 | 1'100 CHF | 92.00% | 1'012'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0438965532 | 0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 97.05% | 756'990.00 | 0.05 | a) |
| CH0438965581 | 1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665 | 0 | 1'850 | 0 | 1'850 CHF | 82.47% | 1'525'695.00 | 0.09 | a) |
| CH0440081393 | 0.0000 % SWISS 0 06/26/34 | 4'130 | 2'650 | 0 | 6'780 CHF | 84.55% | 5'732'490.00 | 0.35 | a) |
| CH0440081401 | 0.0000 % SWISS 0 07/24/39 | 7490 | 1'600 | 0 | 9'090 CHF | 78.04% | 7'093'836.00 | 0.44 | a) |
| CH0440081567 | 1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 | 0 | 3'800 | 0 | 3'800 CHF | 99.64% | 3'786'320.00 | 0.23 | a) |
| CH0441004410 | 0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 87.50% | 175'000.00 | 0.01 | a) |
| CH0441186480 | 0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN | 100 | 250 | 0 | 350 CHF | 95.50% | 334'250.00 | 0.02 | a) |
| CH0441186506 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666 | 2'050 | 0 | 0 | 2'050 CHF | 93.77% | 1'922'285.00 | 0.12 | a) |
| CH0441186514 | 0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN | 2'000 | 250 | 0 | 2'250 CHF | 95.35% | 2'145'375.00 | 0.13 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0441186522 | 0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0443057515 | 0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 94.55% | 567'300.00 | 0.03 | a) |
| CH0444153792 | 0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27 | 670 | 200 | 0 | 870 CHF | 93.50% | 813'450.00 | 0.05 | a) |
| CH0445625004 | 0.0000 % KTBS 0 11/28/23 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 98.85% | 494'265.00 | 0.03 | a) |
| CH0446595677 | 0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26 | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 94.40% | 944'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0446595685 | 0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 92.25% | 369'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0449619052 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667 | 2'550 | 0 | 0 | 2'550 CHF | 94.18% | 2'401'590.00 | 0.15 | a) |
| CH0451141417 | 0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42 | 280 | 300 | 0 | 580 CHF | 83.20% | 482'560.00 | 0.03 | a) |
| CH0457206784 | 0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 91.40% | 182'800.00 | 0.01 | a) |
| CH0457206800 | 0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0458097950 | 0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN | 670 | 750 | 0 | 1'420 CHF | 93.45% | 1'326'990.00 | 0.08 | a) |
| CH0459810534 | 0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 94.65% | 283'950.00 | 0.02 | a) |
| CH0460054403 | 0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 90.05% | 270'150.00 | 0.02 | a) |
| CH0460054429 | 0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668 | 1'450 | 500 | 0 | 1'950 CHF | 80.17% | 1'563'315.00 | 0.10 | a) |
| CH0460872341 | 0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 90.15% | 360'600.00 | 0.02 | a) |
| CH0461238906 | 0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461238930 | 0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27 EMTN | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461238963 | 0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515 | 3'780 | 0 | 0 | 3'780 CHF | 84.40% | 3'190'320.00 | 0.20 | a) |
| CH0461239037 | 0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33 | 1'100 | 0 | 0 | 1'100 CHF | 79.65% | 876'150.00 | 0.05 | a) |
| CH0461239045 | 0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 85.00% | 425'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0461239086 | 0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31 | 0 | 1'500 | 0 | 1'500 CHF | 84.95% | 1'274'250.00 | 0.08 | a) |
| CH0461239136 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516 | 2'780 | 0 | 0 | 2'780 CHF | 84.15% | 2'339'370.00 | 0.14 | a) |
| CH0463112059 | 0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN | 0 | 150 | 0 | 150 CHF | 84.40% | 126'600.00 | 0.01 | a) |
| CH0465044623 | 0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0465044649 | 0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28 | 490 | 0 | 0 | 490 CHF | 90.90% | 445'410.00 | 0.03 | a) |
| CH0467182389 | 0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669 | 0 | 250 | 0 | 250 CHF | 82.35% | 205'875.00 | 0.01 | a) |
| CH0467182454 | 1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0469273509 | 0.0000 % TESSIN 0 04/18/29 | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 89.25% | 562'275.00 | 0.03 | a) |
| CH0471297918 | 0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670 | 1'550 | 0 | 0 | 1'550 CHF | 97.39% | 1'509'545.00 | 0.09 | a) |
| CH0471297926 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671 | 2'000 | 700 | 0 | 2'700 CHF | 88.43% | 2'387'610.00 | 0.15 | a) |
| CH0471297959 | 0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN | 1'840 | 500 | 0 | 2'340 CHF | 91.05% | 2'130'570.00 | 0.13 | a) |
| CH0471297975 | 0.0000 % KTBS 0 05/30/25 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 96.15% | 480'750.00 | 0.03 | a) |
| CH0471297991 | 0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN | 500 | 250 | 0 | 750 CHF | 88.00% | 660'000.00 | 0.04 | a) |
| CH0472691416 | 0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN | 450 | 0 | 0 | 450 CHF | 88.90% | 400'050.00 | 0.02 | a) |
| CH0477380916 | 0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 89.15% | 624'050.00 | 0.04 | a) |
| CH0479222066 | 0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0479514314 | 0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0481013768 | 0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN | 890 | 200 | 0 | 1'090 CHF | 85.75% | 934'675.00 | 0.06 | a) |
| CH0481301031 | 0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 86.55% | 675'090.00 | 0.04 | a) |
| CH0482172340 | 0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN | 1'000 | 0 | 0 | 1'000 CHF | 90.65% | 906'500.00 | 0.06 | a) |
| CH0482172373 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673 | 2'110 | 0 | 0 | 2'110 CHF | 86.46% | 1'824'306.00 | 0.11 | a) |
| CH0482172399 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674 | 1'870 | 0 | 0 | 1'870 CHF | 75.70% | 1'415'590.00 | 0.09 | a) |
| CH0483180938 | 0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29 | 920 | 0 | 0 | 920 CHF | 87.10% | 801'320.00 | 0.05 | a) |
| CH0483181001 | 0.0000 % CS 0 07/16/29 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 83.40% | 250'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0484360380 | 0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39 | 1'330 | 0 | 0 | 1'330 CHF | 76.80% | 1'021'440.00 | 0.06 | a) |
| CH0485252800 | 0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675 | 2'550 | 0 | 0 | 2'550 CHF | 92.10% | 2'348'550.00 | 0.14 | a) |
| CH0485252818 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676 | 3'550 | 0 | 0 | 3'550 CHF | 81.75% | 2'902'125.00 | 0.18 | a) |
| CH0485252826 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677 | 0 | 1'150 | 0 | 1'150 CHF | 73.44% | 844'560.00 | 0.05 | a) |
| CH0485252875 | 0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678 | 2'410 | 700 | 0 | 3'110 CHF | 59.03% | 1'835'833.00 | 0.11 | a) |
| CH0485260837 | 0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000 | 830 | 0 | 830 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0485260902 | 0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44 | 560 | 1'000 | 0 | 1'560 CHF | 63.80% | 995'280.00 | 0.06 | a) |
| CH0485261520 | 0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 91.75% | 513'800.00 | 0.03 | a) |
| CH0485261579 | 0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 90.25% | 676'875.00 | 0.04 | a) |
| CH0485261603 | 0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63 | 560 | 200 | 0 | 760 CHF | 76.70% | 582'920.00 | 0.04 | a) |
| CH0485445982 | 0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN | 760 | 0 | 0 | 760 CHF | 95.40% | 725'040.00 | 0.04 | a) |
| CH0485445990 | 0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN | 580 | 250 | 0 | 830 CHF | 84.75% | 703'425.00 | 0.04 | a) |
| CH0494734392 | 0.0000 % GENEVA 0 09/23/59 | 560 | 450 | 0 | 1'010 CHF | 50.05% | 505'505.00 | 0.03 | a) |
| CH0494734400 | 0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54 | 330 | 0 | 0 | 330 CHF | 48.40% | 159'720.00 | 0.01 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0498589032 | 0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49 | 280 | 200 | 0 | 480 CHF | 59.60% | 286'080.00 | 0.02 | a) |
| CH0502393355 | 0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680 | 1'630 | 0 | 0 | 1'630 CHF | 94.36% | 1'538'068.00 | 0.09 | a) |
| CH0502393389 | 0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0505011913 | 0.0000 % GENEVA 0 05/26/28 | 440 | 600 | 0 | 1'040 CHF | 90.85% | 944'840.00 | 0.06 | a) |
| CH0505011939 | 0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39 | 670 | 600 | 0 | 1'270 CHF | 75.60% | 960'120.00 | 0.06 | a) |
| CH0506071106 | 0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30 | 830 | 0 | 0 | 830 CHF | 86.55% | 718'365.00 | 0.04 | a) |
| CH0506071114 | 0.0000 % KBFRI 0 02/26/30 | 720 | 0 | 0 | 720 CHF | 86.20% | 620'640.00 | 0.04 | a) |
| CH0506071148 | 0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0506071163 | 0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517 | 1'000 | 750 | 0 | 1'750 CHF | 84.92% | 1'486'100.00 | 0.09 | a) |
| CH0506071171 | 0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518 | 1'080 | 350 | 0 | 1'430 CHF | 70.40% | 1'006'720.00 | 0.06 | a) |
| CH0506071189 | 0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28 | 560 | 0 | 560 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0506071221 | 0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147 | 1'500 | 0 | 0 | 1'500 CHF | 86.45% | 1'296'750.00 | 0.08 | a) |
| CH0506071270 | 0.1400 % KBFRI 0.14 06/12/30 | 2'250 | 0 | 0 | 2'250 CHF | 86.50% | 1'946'250.00 | 0.12 | a) |
| CH0506071288 | 0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 89.85% | 179'700.00 | 0.01 | a) |
| CH0506071296 | 0.0000 % LUCERN 0 07/23/30 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 87.30% | 436'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0506071346 | 0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN | 200 | 400 | 0 | 600 CHF | 94.00% | 564'000.00 | 0.03 | a) |
| CH0506071353 | 0.0000 % KBFRI 0 02/05/31 | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 84.25% | 581'325.00 | 0.04 | a) |
| CH0506071395 | 0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36 | 560 | 230 | 0 | 790 CHF | 78.35% | 618'965.00 | 0.04 | a) |
| CH0506668851 | 0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 95.10% | 475'500.00 | 0.03 | a) |
| CH0508785711 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 84.70% | 762'300.00 | 0.05 | a) |
| CH0508785752 | 0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 76.15% | 456'900.00 | 0.03 | a) |
| CH0510906891 | 0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29 | 500 | 500 | 0 | 1'000 CHF | 87.60% | 876'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0511762061 | 0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682 | 500 | 300 | 0 | 800 CHF | 92.46% | 739'680.00 | 0.05 | a) |
| CH0517825268 | 0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN | 1'220 | 0 | 0 | 1'220 CHF | 86.70% | 1'057'740.00 | 0.06 | a) |
| CH0520663581 | 0.0000 % CS 0 07/31/25 EMTN | 1'380 | 0 | 0 | 1'380 CHF | 93.70% | 1'293'060.00 | 0.08 | a) |
| CH0520663599 | 0.0000 % CS 0 10/31/30 EMTN | 1'250 | 200 | 0 | 1'450 CHF | 80.00% | 1'160'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0520663607 | 0.0000 % TRANS 0 02/24/32 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 82.70% | 248'100.00 | 0.02 | a) |
| CH0520663631 | 0.0000 % SWMOB 2020-1 A | 560 | 0 | 560 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0521333655 | 0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0521617297 | 0.0000 % WKBNSW 0 02/14/29 | 300 | 550 | 850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0522158895 | 0.0000 % LUCERN 0 06/25/31 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 85.60% | 479'360.00 | 0.03 | a) |
| CH0522158911 | 0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0522158945 | 0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 85.65% | 428'250.00 | 0.03 | a) |
| CH0522158960 | 0.3126 % KBFRI 0.3126 02/02/32 | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 84.95% | 339'800.00 | 0.02 | a) |
| CH0522158994 | 0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 93.50% | 654'500.00 | 0.04 | a) |
| CH0522690707 | 0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26 | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0525158397 | 0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683 | 4'410 | 0 | 0 | 4'410 CHF | 90.80% | 4'004'280.00 | 0.25 | a) |
| CH0525158413 | 0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 63.42% | 253'680.00 | 0.02 | a) |
| CH0525158454 | 0.0000 % SWIAL 2020-1 A | 560 | 500 | 0 | 1'060 CHF | 96.90% | 1'027'140.00 | 0.06 | a) |
| CH0528881169 | 0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30 | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 86.99% | 1'043'880.00 | 0.06 | a) |
| CH0528881201 | 0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 92.60% | 185'200.00 | 0.01 | a) |
| CH0536892588 | 0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26 | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536892703 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519 | 2'330 | 300 | 0 | 2'630 CHF | 83.95% | 2'207'885.00 | 0.14 | a) |
| CH0536892711 | 0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520 | 1'220 | 0 | 0 | 1'220 CHF | 70.35% | 858'270.00 | 0.05 | a) |
| CH0536892737 | 0.0000 % ZURICH 0 06/23/28 | 1'170 | 0 | 0 | 1'170 CHF | 91.05% | 1'065'285.00 | 0.07 | a) |
| CH0536892745 | 0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45 | 780 | 1'200 | 0 | 1'980 CHF | 68.45% | 1'355'310.00 | 0.08 | a) |
| CH0536892752 | 0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521 | 0 | 150 | 0 | 150 CHF | 87.20% | 130'800.00 | 0.01 | a) |
| CH0536892760 | 0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522 | 250 | 0 | 0 | 250 CHF | 73.11% | 182'775.00 | 0.01 | a) |
| CH0536892901 | 0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523 | 4'720 | 0 | 0 | 4'720 CHF | 79.36% | 3'745'792.00 | 0.23 | a) |
| CH0536893198 | 0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524 | 2'660 | 0 | 0 | 2'660 CHF | 90.20% | 2'399'320.00 | 0.15 | a) |
| CH0536893214 | 0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525 | 700 | 300 | 0 | 1'000 CHF | 78.30% | 783'000.00 | 0.05 | a) |
| CH0536893230 | 0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536893362 | 0.1500 % WKBNSW 0.15 10/05/32 | 450 | 250 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536893370 | 0.6250 % SWICA 2020-1 A | 940 | 0 | 0 | 940 CHF | 99.05% | 931'051.20 | 0.06 | a) |
| CH0536893412 | 0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526 | 2'550 | 0 | 0 | 2'550 CHF | 86.30% | 2'200'650.00 | 0.14 | a) |
| CH0536893461 | 0.1000 % BCJZSW 0.1 01/24/31 0 | 200 | 300 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536893511 | 0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 74.95% | 584'610.00 | 0.04 | a) |
| CH0537261874 | 0.1000 % CM 0.1 10/24/23 EMTN | 1'280 | 0 | 1'280 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0537261924 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686 | 900 | 500 | 0 | 1'400 CHF | 92.33% | 1'292'620.00 | 0.08 | a) |
| CH0537261932 | 0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687 | 200 | 500 | 0 | 700 CHF | 76.79% | 537'530.00 | 0.03 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0538763506 | 0.0960 % BMO 0.096 12/22/23 | 1'280 | 0 | 0 | 1'280 CHF | 98.67% | 1'262'976.00 | 0.08 | a) |
| CH0538763548 | 0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 93.05% | 651'350.00 | 0.04 | a) |
| CH0539032927 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688 | 0 | 2'000 | 0 | 2'000 CHF | 90.89% | 1'817'800.00 | 0.11 | a) |
| CH0540633044 | 0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN | 560 | 450 | 0 | 1'010 CHF | 95.95% | 969'095.00 | 0.06 | a) |
| CH0543827171 | 0.1500 % JURA 0.15 05/22/30 | 1'000 | 150 | 0 | 1'150 CHF | 88.05% | 1'012'575.00 | 0.06 | a) |
| CH0545754688 | 0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32 | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 82.60% | 247'800.00 | 0.02 | a) |
| CH0545766542 | 0.2000 % NADB 0.2 11/28/28 | 330 | 450 | 0 | 780 CHF | 90.05% | 702'390.00 | 0.04 | a) |
| CH0545766559 | 0.5500 % NADB 0.55 05/27/33 | 500 | 200 | 0 | 700 CHF | 85.15% | 596'050.00 | 0.04 | a) |
| CH0545766575 | 0.6250 % SWICC 2020-1 A | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 99.61% | 199'229.40 | 0.01 | a) |
| CH0547243235 | 0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29 | 670 | 100 | 0 | 770 CHF | 88.65% | 682'605.00 | 0.04 | a) |
| CH0547243243 | 0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40 | 670 | 780 | 0 | 1'450 CHF | 74.35% | 1'078'075.00 | 0.07 | a) |
| CH0550103060 | 0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN | 800 | 200 | 0 | 1'000 CHF | 95.05% | 950'500.00 | 0.06 | a) |
| CH0550413345 | 0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN | 670 | 900 | 0 | 1'570 CHF | 87.80% | 1'378'460.00 | 0.08 | a) |
| CH0550413352 | 0.0000 % CS 0 12/17/24 EMTN | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 95.35% | 371'865.00 | 0.02 | a) |
| CH0550413360 | 0.2500 % CS 0 1/4 06/16/28 EMTN | 1'250 | 250 | 0 | 1'500 CHF | 88.00% | 1'320'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0550413378 | 0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 84.65% | 253'950.00 | 0.02 | a) |
| CH0550413386 | 0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50 | 200 | 0 | 0 | 200 CHF | 64.65% | 129'300.00 | 0.01 | a) |
| CH0550413428 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689 | 1'640 | 0 | 0 | 1'640 CHF | 70.57% | 1'157'348.00 | 0.07 | a) |
| CH0551990705 | 0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50 | 390 | 0 | 0 | 390 CHF | 64.10% | 249'990.00 | 0.02 | a) |
| CH0553331809 | 1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0553331833 | 0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50 | 220 | 100 | 0 | 320 CHF | 61.00% | 195'200.00 | 0.01 | a) |
| CH0553331858 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690 | 3'390 | 0 | 0 | 3'390 CHF | 87.01% | 2'949'639.00 | 0.18 | a) |
| CH0553331866 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691 | 1'450 | 500 | 0 | 1'950 CHF | 72.21% | 1'408'095.00 | 0.09 | a) |
| CH0553331882 | 0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN | 1'000 | 1'000 | 0 | 2'000 CHF | 95.90% | 1'918'000.00 | 0.12 | a) |
| CH0555837753 | 1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778310 | 0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 | 3'230 | 3'500 | 0 | 6'730 CHF | 85.87% | 5'779'051.00 | 0.36 | a) |
| CH0557778492 | 2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 0000 | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778500 | 0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 MAR | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778518 | 4.0000 % SWISS 4 01/06/49 MAR | 0 | 100 | 100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778534 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45 APR | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778567 | 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37 JUN | 0 | 900 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778583 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 JUL | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778625 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32 NOV | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778633 | 1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37 NOV | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778641 | 2.0000 % SWISS 2 06/25/64 NOV | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778658 | 2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31 DEC | 0 | 550 | 550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778666 | 0.0000 % SWISS 0 07/24/39 0001 | 0 | 1'100 | 1'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778674 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 DEC | 0 | 1'500 | 1'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778682 | 0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 JAN | 0 | 1'150 | 1'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778690 | 0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 JAN | 0 | 1'500 | 1'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778708 | 4.0000 % SWISS 4 01/06/49 0001 | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778716 | 0.0000 % SWISS 0 06/22/29 FEB | 0 | 1'500 | 1'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0557778724 | 2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 FEB | 0 | 950 | 950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0561923845 | 0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0561923878 | 0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60 | 520 | 0 | 0 | 520 CHF | 48.75% | 253'500.00 | 0.02 | a) |
| CH0564642046 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692 | 1'550 | 450 | 0 | 2'000 CHF | 71.06% | 1'421'200.00 | 0.09 | a) |
| CH0564642053 | 0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 86.55% | 649'125.00 | 0.04 | a) |
| CH0564642095 | 0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN | 1'250 | 150 | 0 | 1'400 CHF | 87.10% | 1'219'400.00 | 0.07 | a) |
| CH0568056219 | 0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44 | 180 | 300 | 0 | 480 CHF | 68.70% | 329'760.00 | 0.02 | a) |
| CH0569237651 | 0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30 | 1'030 | 0 | 0 | 1'030 CHF | 87.35% | 899'705.00 | 0.06 | a) |
| CH0569237669 | 0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35 | 970 | 0 | 0 | 970 CHF | 80.20% | 777'940.00 | 0.05 | a) |
| CH0569237677 | 0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN | 810 | 200 | 0 | 1'010 CHF | 87.75% | 886'275.00 | 0.05 | a) |
| CH0570347341 | 0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0 | 440 | 200 | 0 | 640 CHF | 84.10% | 538'240.00 | 0.03 | a) |
| CH0570576121 | 0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148 | 1'030 | 0 | 0 | 1'030 CHF | 81.80% | 842'540.00 | 0.05 | a) |
| CH0570576154 | 0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528 | 1'650 | 1'850 | 0 | 3'500 CHF | 86.90% | 3'041'500.00 | 0.19 | a) |
| CH0570576303 | 0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56 | 190 | 0 | 0 | 190 CHF | 59.25% | 112'575.00 | 0.01 | a) |
| CH0572327002 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694 | 1'550 | 0 | 0 | 1'550 CHF | 81.40% | 1'261'700.00 | 0.08 | a) |
| CH0572327028 | 0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN | 780 | 350 | 0 | 1'130 CHF | 95.25% | 1'076'325.00 | 0.07 | a) |
| CH0575017014 | 0.6250 % SWMOB 2020-2 A | 440 | 0 | 0 | 440 CHF | 98.53% | 433'550.48 | 0.03 | a) |
| CH0575017071 | 0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695 | 2'890 | 0 | 0 | 2'890 CHF | 87.70% | 2'534'530.00 | 0.16 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0575017089 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696 | 2'890 | 200 | 0 | 3'090 CHF | 82.90% | 2'561'610.00 | 0.16 | a) |
| CH0576005877 | 0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60 | 560 | 0 | 0 | 560 CHF | 45.75% | 256'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0577734301 | 0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30 | 470 | 0 | 0 | 470 CHF | 84.85% | 398'795.00 | 0.02 | a) |
| CH0579132918 | 0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70 | 470 | 0 | 0 | 470 CHF | 38.50% | 180'950.00 | 0.01 | a) |
| CH0581947790 | 0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN | 870 | 0 | 0 | 870 CHF | 91.40% | 795'180.00 | 0.05 | a) |
| CH0589030946 | 0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149 | 1'470 | 400 | 0 | 1'870 CHF | 81.40% | 1'522'180.00 | 0.09 | a) |
| CH0589031019 | 0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529 | 1'650 | 1'200 | 0 | 2'850 CHF | 89.07% | 2'538'495.00 | 0.16 | a) |
| CH0589031027 | 0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 81.20% | 1'299'200.00 | 0.08 | a) |
| CH0589031035 | 0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531 | 2'330 | 0 | 0 | 2'330 CHF | 76.26% | 1'776'858.00 | 0.11 | a) |
| CH0589031118 | 0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532 | 1'000 | 1'200 | 0 | 2'200 CHF | 84.75% | 1'864'500.00 | 0.11 | a) |
| CH0591979619 | 0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697 | 250 | 1'100 | 0 | 1'350 CHF | 68.35% | 922'725.00 | 0.06 | a) |
| CH0591979643 | 0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 90.30% | 361'200.00 | 0.02 | a) |
| CH0591979650 | 0.0000 % CS 0 01/27/27 EMTN | 400 | 0 | 0 | 400 CHF | 89.85% | 359'400.00 | 0.02 | a) |
| CH0591979668 | 0.0000 % CS 0 01/27/33 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 75.25% | 376'250.00 | 0.02 | a) |
| CH0593893958 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698 | 1'330 | 0 | 0 | 1'330 CHF | 82.45% | 1'096'585.00 | 0.07 | a) |
| CH0593893966 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 72.60% | 290'400.00 | 0.02 | a) |
| CH0593893974 | 0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN | 1'060 | 0 | 0 | 1'060 CHF | 68.95% | 730'870.00 | 0.04 | a) |
| CH0593893982 | 0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN | 360 | 200 | 0 | 560 CHF | 70.65% | 395'640.00 | 0.02 | a) |
| CH0593893990 | 0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1100259758 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700 | 2'870 | 500 | 0 | 3'370 CHF | 86.00% | 2'898'200.00 | 0.18 | a) |
| CH1100259774 | 0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31 | 600 | 0 | 0 | 600 CHF | 83.70% | 502'200.00 | 0.03 | a) |
| CH1100259782 | 0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 86.00% | 645'000.00 | 0.04 | a) |
| CH1100259790 | 0.0000 % TESSIN 0 03/31/26 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 94.45% | 472'250.00 | 0.03 | a) |
| CH1100259808 | 0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 72.45% | 499'905.00 | 0.03 | a) |
| CH1101096464 | 0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150 | 1'720 | 0 | 0 | 1'720 CHF | 85.05% | 1'462'860.00 | 0.09 | a) |
| CH1101096514 | 0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35 | 0 | 550 | 550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1101096522 | 0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534 | 4'000 | 0 | 0 | 4'000 CHF | 90.74% | 3'629'600.00 | 0.22 | a) |
| CH1101096530 | 0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 83.60% | 167'200.00 | 0.01 | a) |
| CH1101096613 | 0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1101096621 | 0.0000 % ZURICH 0 11/10/33 | 2'140 | 0 | 0 | 2'140 CHF | 82.20% | 1'759'080.00 | 0.11 | a) |
| CH1101096647 | 0.1000 % GRKPSW 0.1 05/07/31 | 850 | 350 | 1'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1104885954 | 0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN | 0 | 200 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1105672682 | 0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN | 1'390 | 400 | 0 | 1'790 CHF | 84.60% | 1'514'340.00 | 0.09 | a) |
| CH1105672708 | 0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1105672724 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701 | 2'330 | 300 | 0 | 2'630 CHF | 85.45% | 2'247'335.00 | 0.14 | a) |
| CH1105672732 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702 | 1'220 | 0 | 0 | 1'220 CHF | 79.21% | 966'362.00 | 0.06 | a) |
| CH1105672740 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703 | 1'890 | 0 | 0 | 1'890 CHF | 73.17% | 1'382'913.00 | 0.08 | a) |
| CH1111392853 | 0.0000 % BERN 0 05/18/33 | 440 | 0 | 0 | 440 CHF | 82.45% | 362'780.00 | 0.02 | a) |
| CH1111392861 | 0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31 | 1'000 | 0 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1112011569 | 0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 86.55% | 675'090.00 | 0.04 | a) |
| CH1112940601 | 0.0500 % NIDKBK 0.05 05/27/31 | 690 | 0 | 0 | 690 CHF | 84.25% | 581'325.00 | 0.04 | a) |
| CH1113135151 | 0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32 | 1'110 | 0 | 0 | 1'110 CHF | 82.95% | 920'745.00 | 0.06 | a) |
| CH1113755461 | 0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31 | 780 | 0 | 0 | 780 CHF | 84.25% | 657'150.00 | 0.04 | a) |
| CH1115424678 | 0.2000 % SFZSSW 0.2 06/15/26 | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1118223382 | 1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1118223408 | 0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1118223424 | 0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537 | 1'700 | 0 | 0 | 1'700 CHF | 83.40% | 1'417'800.00 | 0.09 | a) |
| CH1118223507 | 0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65 | 400 | 350 | 0 | 750 CHF | 72.50% | 543'750.00 | 0.03 | a) |
| CH1118483663 | 0.3500 % SWICC 2021-1 A | 620 | 0 | 0 | 620 CHF | 97.75% | 606'050.00 | 0.04 | a) |
| CH1121837228 | 0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN | 950 | 0 | 0 | 950 CHF | 82.15% | 780'425.00 | 0.05 | a) |
| CH1122290187 | 0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704 | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 91.31% | 182'620.00 | 0.01 | a) |
| CH1122290211 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705 | 650 | 750 | 0 | 1'400 CHF | 71.29% | 998'060.00 | 0.06 | a) |
| CH1122290237 | 0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN | 630 | 0 | 0 | 630 CHF | 76.20% | 480'060.00 | 0.03 | a) |
| CH1127263965 | 0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41 | 450 | 0 | 0 | 450 CHF | 69.90% | 314'550.00 | 0.02 | a) |
| CH1129053794 | 0.1250 % WKBSNW 0 1/8 09/15/33 | 450 | 250 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1130818813 | 0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36 | 440 | 0 | 0 | 440 CHF | 76.75% | 337'700.00 | 0.02 | a) |
| CH1131931243 | 0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538 | 3'220 | 250 | 0 | 3'470 CHF | 84.30% | 2'925'210.00 | 0.18 | a) |
| CH1131931250 | 0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539 | 600 | 0 | 0 | 600 CHF | 75.13% | 450'780.00 | 0.03 | a) |
| CH1131931276 | 0.0000 % KSWINT 0 09/30/25 | 0 | 200 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1131931300 | 0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1131931318 | 0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1131931326 | 0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1131931342 | 0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152 | 250 | 200 | 0 | 450 CHF | 84.55% | 380'475.00 | 0.02 a) | |
| CH1131931375 | 0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 85.05% | 340'200.00 | 0.02 a) | |
| CH1131931409 | 0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540 | 1'170 | 0 | 0 | 1'170 CHF | 78.70% | 920'790.00 | 0.06 a) | |
| CH1132966297 | 0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31 | 750 | 0 | 0 | 750 CHF | 82.00% | 615'000.00 | 0.04 a) | |
| CH1132966321 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706 | 1'830 | 0 | 0 | 1'830 CHF | 85.13% | 1'557'879.00 | 0.10 a) | |
| CH1132966339 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707 | 750 | 750 | 0 | 1'500 CHF | 78.86% | 1'182'900.00 | 0.07 a) | |
| CH1132966347 | 0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29 | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1132966354 | 0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1135555584 | 0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1137122789 | 1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1137122805 | 0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29 | 440 | 0 | 0 | 440 CHF | 87.90% | 386'760.00 | 0.02 a) | |
| CH1137122839 | 0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN | 1'100 | 200 | 0 | 1'300 CHF | 86.65% | 1'126'450.00 | 0.07 a) | |
| CH1137407420 | 0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1137407453 | 0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN | 300 | 0 | 0 | 300 CHF | 88.30% | 264'900.00 | 0.02 a) | |
| CH1139995802 | 0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1139995810 | 0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26 | 600 | 700 | 0 | 1'300 CHF | 93.20% | 1'211'600.00 | 0.07 a) | |
| CH1141700430 | 0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51 | 250 | 400 | 0 | 650 CHF | 63.45% | 412'425.00 | 0.03 a) | |
| CH1141700463 | 0.2000 % BERN 0.2 11/26/36 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 78.70% | 472'200.00 | 0.03 a) | |
| CH1141700521 | 0.0000 % AMALEA 0 02/18/25 | 525 | 550 | 0 | 1'075 CHF | 95.45% | 1'026'087.50 | 0.06 a) | |
| CH1141700539 | 0.1000 % GRKPSW 0.1 12/07/29 | 600 | 0 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1141700547 | 0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1141944459 | 0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 51.65% | 258'250.00 | 0.02 a) | |
| CH1142754253 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708 | 1'400 | 750 | 0 | 2'150 CHF | 85.15% | 1'830'725.00 | 0.11 a) | |
| CH1146382481 | 0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31 | 0 | 400 | 400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1148266161 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709 | 575 | 0 | 0 | 575 CHF | 90.13% | 518'247.50 | 0.03 a) | |
| CH1148266195 | 0.6250 % SYNNVX 0 5/8 08/30/24 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1148266237 | 0.3500 % BSTDBK 0.35 03/15/27 EMTN | 300 | 0 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1148266245 | 0.3000 % WKBNSW 0.3 02/07/30 | 250 | 0 | 250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1148267755 | 0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29 | 450 | 0 | 0 | 450 CHF | 87.70% | 394'650.00 | 0.02 a) | |
| CH1148308708 | 0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN | 650 | 0 | 0 | 650 CHF | 84.55% | 549'575.00 | 0.03 a) | |
| CH1148308716 | 0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 86.45% | 432'250.00 | 0.03 a) | |
| CH1148728046 | 0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541 | 1'200 | 900 | 0 | 2'100 CHF | 85.46% | 1'794'660.00 | 0.11 a) | |
| CH1148728111 | 0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153 | 950 | 0 | 0 | 950 CHF | 87.00% | 826'500.00 | 0.05 a) | |
| CH1148728178 | 0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542 | 800 | 400 | 0 | 1'200 CHF | 85.20% | 1'022'400.00 | 0.06 a) | |
| CH1148728186 | 0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543 | 550 | 0 | 0 | 550 CHF | 74.49% | 409'695.00 | 0.03 a) | |
| CH1148728251 | 0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544 | 1'400 | 0 | 0 | 1'400 CHF | 93.33% | 1'306'620.00 | 0.08 a) | |
| CH1148728269 | 0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545 | 1'500 | 0 | 0 | 1'500 CHF | 89.15% | 1'337'250.00 | 0.08 a) | |
| CH1148728277 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546 | 400 | 200 | 0 | 600 CHF | 83.50% | 501'000.00 | 0.03 a) | |
| CH1149985959 | 0.0000 % EUROF 0 12/22/31 | 650 | 0 | 0 | 650 CHF | 84.45% | 548'925.00 | 0.03 a) | |
| CH1151526154 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710 | 3'850 | 0 | 0 | 3'850 CHF | 84.52% | 3'254'020.00 | 0.20 a) | |
| CH1151526170 | 0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711 | 550 | 0 | 0 | 550 CHF | 89.65% | 493'075.00 | 0.03 a) | |
| CH1151526196 | 0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712 | 1'500 | 0 | 0 | 1'500 CHF | 79.08% | 1'186'200.00 | 0.07 a) | |
| CH1151526238 | 0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN | 1'900 | 0 | 0 | 1'900 CHF | 92.05% | 1'748'950.00 | 0.11 a) | |
| CH1158693296 | 0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 88.40% | 530'400.00 | 0.03 a) | |
| CH1160382896 | 0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28 | 150 | 200 | 0 | 350 CHF | 89.80% | 314'300.00 | 0.02 a) | |
| CH1160382904 | 0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1160382912 | 0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713 | 450 | 600 | 0 | 1'050 CHF | 94.15% | 988'575.00 | 0.06 a) | |
| CH1160382953 | 0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26 MAR | 200 | 0 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1160382961 | 0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26 MAR | 50 | 0 | 50 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1160382987 | 0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 85.50% | 769'500.00 | 0.05 a) | |
| CH1166151923 | 0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 93.54% | 280'620.00 | 0.02 a) | |
| CH1166151931 | 0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 MAR | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1166151949 | 0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715 | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 85.25% | 1'065'625.00 | 0.07 a) | |
| CH1166151964 | 0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27 | 0 | 610 | 0 | 610 CHF | 94.05% | 573'705.00 | 0.04 a) | |
| CH1166151972 | 0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 94.20% | 659'400.00 | 0.04 a) | |
| CH1167134845 | 0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58 | 500 | 0 | 0 | 500 CHF | 59.25% | 296'250.00 | 0.02 a) | |
| CH1167887251 | 0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 93.35% | 1'493'600.00 | 0.09 a) | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1170565621 | 0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154 | 0 | 450 | 0 | 450 CHF | 91.50% | 411'750.00 | 0.03 | a) |
| CH1170565654 | 0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 91.30% | 821'700.00 | 0.05 | a) |
| CH1170565662 | 0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 89.14% | 579'410.00 | 0.04 | a) |
| CH1170565670 | 1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 86.06% | 559'390.00 | 0.03 | a) |
| CH1170565696 | 0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155 | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 96.45% | 1'157'400.00 | 0.07 | a) |
| CH1170565720 | 1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32 | 0 | 450 | 0 | 450 CHF | 92.00% | 414'000.00 | 0.03 | a) |
| CH1170565738 | 1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66 | 0 | 680 | 0 | 680 CHF | 89.30% | 607'240.00 | 0.04 | a) |
| CH1170565795 | 1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550 | 0 | 1'850 | 0 | 1'850 CHF | 95.86% | 1'773'410.00 | 0.11 | a) |
| CH1170565803 | 1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551 | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 94.25% | 2'639'000.00 | 0.16 | a) |
| CH1170565811 | 1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552 | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 89.88% | 1'617'840.00 | 0.10 | a) |
| CH1174335724 | 0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 93.90% | 187'800.00 | 0.01 | a) |
| CH1174335757 | 0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN | 0 | 1'300 | 0 | 1'300 CHF | 94.80% | 1'232'400.00 | 0.08 | a) |
| CH1174335765 | 0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN | 0 | 1'100 | 0 | 1'100 CHF | 94.40% | 1'038'400.00 | 0.06 | a) |
| CH1174335781 | 1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716 | 0 | 1'350 | 0 | 1'350 CHF | 92.91% | 1'254'285.00 | 0.08 | a) |
| CH1174335799 | 1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 APR | 0 | 200 | 200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1174335807 | 1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 80.98% | 647'840.00 | 0.04 | a) |
| CH1174335815 | 0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 93.80% | 938'000.00 | 0.06 | a) |
| CH1175016091 | 0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 95.40% | 286'200.00 | 0.02 | a) |
| CH1177791840 | 0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 91.40% | 822'600.00 | 0.05 | a) |
| CH1177791865 | 0.2950 % BNS 0.295 04/25/25 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 96.50% | 675'500.00 | 0.04 | a) |
| CH1177791873 | 0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 92.55% | 601'575.00 | 0.04 | a) |
| CH1179184416 | 0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 93.40% | 1'120'800.00 | 0.07 | a) |
| CH1179184424 | 0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN | 0 | 750 | 0 | 750 CHF | 94.85% | 711'375.00 | 0.04 | a) |
| CH1179534933 | 1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29 | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1179534958 | 0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN | 0 | 1'050 | 0 | 1'050 CHF | 94.00% | 987'000.00 | 0.06 | a) |
| CH1179534982 | 1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 95.35% | 762'800.00 | 0.05 | a) |
| CH1179534990 | 1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN | 0 | 850 | 0 | 850 CHF | 93.80% | 797'300.00 | 0.05 | a) |
| CH1179535005 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 MAY | 0 | 900 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1179535013 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 94.32% | 1'509'120.00 | 0.09 | a) |
| CH1179535021 | 1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 93.70% | 655'900.00 | 0.04 | a) |
| CH1184694748 | 0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 94.35% | 377'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1184694789 | 1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN | 0 | 300 | 300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1188229772 | 1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 96.40% | 385'600.00 | 0.02 | a) |
| CH1189217719 | 1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30 | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1189217818 | 1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29 | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1189217826 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553 | 0 | 2'150 | 0 | 2'150 CHF | 96.90% | 2'083'350.00 | 0.13 | a) |
| CH1189217834 | 1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554 | 0 | 2'450 | 0 | 2'450 CHF | 96.88% | 2'373'560.00 | 0.15 | a) |
| CH1189217842 | 1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555 | 0 | 1'050 | 0 | 1'050 CHF | 96.93% | 1'017'765.00 | 0.06 | a) |
| CH1189217859 | 1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 100.30% | 802'400.00 | 0.05 | a) |
| CH1189217891 | 1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556 | 0 | 1'300 | 0 | 1'300 CHF | 96.30% | 1'251'900.00 | 0.08 | a) |
| CH1189217909 | 1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557 | 0 | 1'400 | 0 | 1'400 CHF | 96.25% | 1'347'500.00 | 0.08 | a) |
| CH1189217917 | 1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558 | 0 | 1'500 | 0 | 1'500 CHF | 96.52% | 1'447'800.00 | 0.09 | a) |
| CH1189217925 | 1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 96.50% | 675'500.00 | 0.04 | a) |
| CH1189217982 | 1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30 AUG | 0 | 100 | 100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1191066187 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720 | 0 | 1'900 | 0 | 1'900 CHF | 94.49% | 1'795'310.00 | 0.11 | a) |
| CH1191066195 | 1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 JUNE | 0 | 1'450 | 1'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1191066203 | 1.0725 % SWICC 2022-1 A | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 96.25% | 673'750.00 | 0.04 | a) |
| CH1191066237 | 1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 90.45% | 904'500.00 | 0.06 | a) |
| CH1191066278 | 1.5462 % CABEL 1.5462 11/30/26 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 97.30% | 389'200.00 | 0.02 | a) |
| CH1193213027 | 1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 98.40% | 885'600.00 | 0.05 | a) |
| CH1193213076 | 1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 98.10% | 392'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1193213100 | 1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 98.25% | 884'250.00 | 0.05 | a) |
| CH1193213126 | 1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 97.95% | 391'800.00 | 0.02 | a) |
| CH1194355033 | 1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN | 0 | 950 | 0 | 950 CHF | 98.90% | 939'550.00 | 0.06 | a) |
| CH1194355041 | 2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 JUL | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1194355058 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 100.70% | 1'711'900.00 | 0.11 | a) |
| CH1194355066 | 2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722 | 0 | 1'650 | 0 | 1'650 CHF | 103.32% | 1'704'780.00 | 0.10 | a) |
| CH1194355074 | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 105.66% | 845'280.00 | 0.05 | a) |
| CH1194355082 | 1.8750 % CS 1 7/8 06/29/26 EMTN | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 97.35% | 681'450.00 | 0.04 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH119555409 | 1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 97.05% | 485'250.00 | 0.03 | a) |
| CH1196216985 | 2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34 | 0 | 360 | 0 | 360 CHF | 100.65% | 362'340.00 | 0.02 | a) |
| CH1196216993 | 1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 98.85% | 988'500.00 | 0.06 | a) |
| CH1199322343 | 2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47 | 0 | 595 | 0 | 595 CHF | 101.80% | 605'710.00 | 0.04 | a) |
| CH1199322384 | 0.9194 % NWISE 0.9194 12/17/25 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 97.05% | 630'825.00 | 0.04 | a) |
| CH1199659934 | 2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 99.35% | 695'450.00 | 0.04 | a) |
| CH1199659942 | 1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34 | 0 | 250 | 0 | 250 CHF | 99.60% | 249'000.00 | 0.02 | a) |
| CH1199659967 | 1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 AUG | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1199659975 | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 97.11% | 1'553'760.00 | 0.10 | a) |
| CH1199660007 | 1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 95.60% | 382'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1202242223 | 1.5203 % NWISE 1.5203 12/17/29 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 96.15% | 865'350.00 | 0.05 | a) |
| CH1202242249 | 0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN | 0 | 850 | 0 | 850 CHF | 96.65% | 821'525.00 | 0.05 | a) |
| CH1204175132 | 0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN | 0 | 740 | 0 | 740 CHF | 97.30% | 720'020.00 | 0.04 | a) |
| CH1204175140 | 1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN | 0 | 1'030 | 0 | 1'030 CHF | 94.80% | 976'440.00 | 0.06 | a) |
| CH1204259738 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 94.22% | 1'601'740.00 | 0.10 | a) |
| CH1204259746 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727 | 0 | 850 | 0 | 850 CHF | 91.00% | 773'500.00 | 0.05 | a) |
| CH1204259761 | 1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26 | 0 | 450 | 450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1204259795 | 1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 96.65% | 628'225.00 | 0.04 | a) |
| CH1204259803 | 1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 97.60% | 683'200.00 | 0.04 | a) |
| CH1206367414 | 1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 SEP | 0 | 950 | 950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1206367422 | 1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 96.75% | 1'548'000.00 | 0.10 | a) |
| CH1206367513 | 1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 OCT | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1206367521 | 2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 100.57% | 603'420.00 | 0.04 | a) |
| CH1206367539 | 2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562 | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 101.18% | 1'264'750.00 | 0.08 | a) |
| CH1206367562 | 2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 99.85% | 399'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1206367570 | 1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563 | 0 | 550 | 0 | 550 CHF | 99.23% | 545'765.00 | 0.03 | a) |
| CH1206367588 | 2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564 | 0 | 1'400 | 0 | 1'400 CHF | 100.80% | 1'411'200.00 | 0.09 | a) |
| CH1206367596 | 2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565 | 0 | 850 | 0 | 850 CHF | 103.04% | 875'840.00 | 0.05 | a) |
| CH1206367620 | 2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 103.35% | 310'050.00 | 0.02 | a) |
| CH1206367638 | 1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 99.25% | 595'500.00 | 0.04 | a) |
| CH1206367679 | 1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29 | 0 | 1'550 | 0 | 1'550 CHF | 97.95% | 1'518'225.00 | 0.09 | a) |
| CH1209697551 | 1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 95.00% | 570'000.00 | 0.04 | a) |
| CH1210198128 | 2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 97.00% | 873'000.00 | 0.05 | a) |
| CH1210198144 | 2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27 | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1211713156 | 1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 97.75% | 391'000.00 | 0.02 | a) |
| CH1211713164 | 1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 96.70% | 290'100.00 | 0.02 | a) |
| CH1211713172 | 1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 96.45% | 626'925.00 | 0.04 | a) |
| CH1211713206 | 1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 98.40% | 787'200.00 | 0.05 | a) |
| CH1211713214 | 2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34 | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 99.10% | 396'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1212189133 | 1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 96.85% | 387'400.00 | 0.02 | a) |
| CH1212189166 | 1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 98.20% | 589'200.00 | 0.04 | a) |
| CH1213243871 | 1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 98.30% | 589'800.00 | 0.04 | a) |
| CH1214797123 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 SEP | 0 | 550 | 550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1214797131 | 2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728 | 0 | 1'950 | 0 | 1'950 CHF | 98.99% | 1'930'305.00 | 0.12 | a) |
| CH1214797149 | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 SEP | 0 | 500 | 500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1214797164 | 2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 99.55% | 298'650.00 | 0.02 | a) |
| CH1216400056 | 2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 99.80% | 648'700.00 | 0.04 | a) |
| CH1216400064 | 2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27 | 0 | 750 | 0 | 750 CHF | 100.90% | 756'750.00 | 0.05 | a) |
| CH1216400080 | 1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 99.20% | 297'600.00 | 0.02 | a) |
| CH1217066583 | 1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29 | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 98.90% | 1'186'800.00 | 0.07 | a) |
| CH1217066591 | 2.0000 % KBBL 2 02/23/34 | 0 | 1'050 | 0 | 1'050 CHF | 98.60% | 1'035'300.00 | 0.06 | a) |
| CH1218301955 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730 | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 100.51% | 653'315.00 | 0.04 | a) |
| CH1218301963 | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731 | 0 | 2'350 | 0 | 2'350 CHF | 102.04% | 2'397'940.00 | 0.15 | a) |
| CH1218302011 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 NOV | 0 | 250 | 250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1218302029 | 2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 NOV | 0 | 1'000 | 1'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1218302037 | 2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV | 0 | 1'150 | 1'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1221150464 | 2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 100.25% | 300'750.00 | 0.02 | a) |
| CH1221150480 | 1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN | 0 | 1'100 | 0 | 1'100 CHF | 99.80% | 1'097'800.00 | 0.07 | a) |
| CH1223336004 | 2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072 | 0 | 260 | 0 | 260 CHF | 91.00% | 236'600.00 | 0.01 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------|------|
| CH1223665055 | 2.0000 % TESSIN 2 11/20/37 | 0 | 515 | 0 | 515 CHF | 99.50% | 512'425.00 | 0.03 | a) |
| CH1228837873 | 3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN | 0 | 550 | 0 | 550 CHF | 104.20% | 573'100.00 | 0.04 | a) |
| CH1228837881 | 1.5150 % DB5SP 1.515 12/12/25 | 0 | 750 | 0 | 750 CHF | 98.65% | 739'875.00 | 0.05 | a) |
| CH1230759511 | 1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 DEC | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1230759529 | 2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 DEC | 0 | 1'700 | 1'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1230759537 | 1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 97.50% | 390'000.00 | 0.02 | a) |
| CH1231094371 | 1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33 | 0 | 350 | 0 | 350 CHF | 97.95% | 342'825.00 | 0.02 | a) |
| CH1231312674 | 1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 98.55% | 591'300.00 | 0.04 | a) |
| CH1231312682 | 2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 98.40% | 393'600.00 | 0.02 | a) |
| CH1232106992 | 2.4300 % SWMOB 2022-1 A | 0 | 750 | 0 | 750 CHF | 99.60% | 747'000.00 | 0.05 | a) |
| CH1232107024 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566 | 0 | 495 | 0 | 495 CHF | 98.31% | 486'634.50 | 0.03 | a) |
| CH1232107032 | 1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567 | 0 | 1'150 | 0 | 1'150 CHF | 97.66% | 1'123'090.00 | 0.07 | a) |
| CH1232107040 | 1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568 | 0 | 1'550 | 0 | 1'550 CHF | 97.05% | 1'504'275.00 | 0.09 | a) |
| CH1232107073 | 1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 94.55% | 283'650.00 | 0.02 | a) |
| CH1232107149 | 1.6250 % ZURCTY 1 5/8 02/12/37 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 95.60% | 669'200.00 | 0.04 | a) |
| CH1232107172 | 1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29 | 0 | 350 | 0 | 350 CHF | 98.21% | 343'724.50 | 0.02 | a) |
| CH1233294920 | 1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 97.20% | 486'000.00 | 0.03 | a) |
| CH1233900005 | 1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN | 0 | 550 | 0 | 550 CHF | 98.95% | 544'225.00 | 0.03 | a) |
| CH1236363409 | 1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26 | 0 | 1'100 | 0 | 1'100 CHF | 99.30% | 1'092'300.00 | 0.07 | a) |
| CH1236363417 | 2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30 | 0 | 550 | 0 | 550 CHF | 99.40% | 546'700.00 | 0.03 | a) |
| CH1239464535 | 1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 FEB | 0 | 850 | 850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1239464543 | 1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 FEB | 0 | 700 | 700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1239464550 | 1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 97.29% | 778'320.00 | 0.05 | a) |
| CH1239464568 | 2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48 | 0 | 450 | 0 | 450 CHF | 95.26% | 428'670.00 | 0.03 | a) |
| CH1239464576 | 2.4925 % SWMOB 2023-1 A | 0 | 530 | 0 | 530 CHF | 99.20% | 525'739.86 | 0.03 | a) |
| CH1239464618 | 1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR | 0 | 850 | 0 | 850 CHF | 96.99% | 824'440.50 | 0.05 | a) |
| CH1239464626 | 1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 96.67% | 1'208'350.00 | 0.07 | a) |
| CH1239464634 | 2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 | 0 | 785 | 0 | 785 CHF | 101.41% | 796'044.95 | 0.05 | a) |
| CH1239464659 | 1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68 | 0 | 800 | 0 | 800 CHF | 101.12% | 808'992.00 | 0.05 | a) |
| CH1239494979 | 1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN | 0 | 550 | 0 | 550 CHF | 99.00% | 544'500.00 | 0.03 | a) |
| CH1239494987 | 1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732 | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 98.79% | 691'530.00 | 0.04 | a) |
| CH1239494995 | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 98.25% | 1'670'250.00 | 0.10 | a) |
| CH1239495000 | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 JAN | 0 | 800 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1239495059 | 1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 97.90% | 489'500.00 | 0.03 | a) |
| CH1239495067 | 1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN | 0 | 650 | 0 | 650 CHF | 98.60% | 640'900.00 | 0.04 | a) |
| CH1242301302 | 1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28 | 0 | 1'100 | 0 | 1'100 CHF | 98.81% | 1'086'932.00 | 0.07 | a) |
| CH1243018798 | 1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 98.40% | 492'000.00 | 0.03 | a) |
| CH1243651911 | 1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 96.20% | 865'800.00 | 0.05 | a) |
| CH1243651952 | 1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734 | 0 | 1'450 | 0 | 1'450 CHF | 99.31% | 1'439'995.00 | 0.09 | a) |
| CH1243651960 | 2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 FEB | 0 | 600 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1243651978 | 1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 FEB | 0 | 550 | 550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1243651986 | 1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR | 0 | 200 | 0 | 200 CHF | 97.32% | 194'644.00 | 0.01 | a) |
| CH1243933574 | 1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26 | 0 | 600 | 0 | 600 CHF | 99.35% | 596'100.00 | 0.04 | a) |
| CH1243933582 | 1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28 | 0 | 300 | 0 | 300 CHF | 98.25% | 294'750.00 | 0.02 | a) |
| CH1243933590 | 2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN | 0 | 700 | 0 | 700 CHF | 98.26% | 687'820.00 | 0.04 | a) |
| CH1249151049 | 1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 98.05% | 392'200.00 | 0.02 | a) |
| CH1249416020 | 1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN | 0 | 1'000 | 0 | 1'000 CHF | 99.41% | 994'070.00 | 0.06 | a) |
| CH1251030107 | 1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN | 0 | 1'300 | 0 | 1'300 CHF | 99.88% | 1'298'427.00 | 0.08 | a) |
| CHF | | | | | | | 1'155'315'146.89 | 70.99 | |

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

453'499'429.73 27.86

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

453'499'429.73 27.86

| | | | | | | | | | |
|--------------|---|-----------|-----------|--------|---------------|-------|----------------|-------|----|
| CH1117196035 | SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF | 3'858'115 | 1'152'266 | 54'092 | 4'956'289 CHF | 91.50 | 453'499'429.73 | 27.86 | a) |
|--------------|---|-----------|-----------|--------|---------------|-------|----------------|-------|----|

CHF 453'499'429.73 27.86

| Vermögensaufstellung | Kurswert CHF | in % 7) |
|---|-------------------------|--------------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 10'322'443.08 | 0.63 |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 1'155'315'146.89 | 70.99 |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 453'499'429.73 | 27.86 |
| Sonstige Vermögenswerte | 8'395'433.00 | 0.52 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 1'627'532'452.70 | 100.00 |
| Andere Verbindlichkeiten | -30'370.93 | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 1'627'502'081.77 | |

| Bewertungskategorien | Kurswert CHF | in % 7) |
|--|-------------------------|--------------------|
| a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG); | 1'608'814'576.62 | 98.85 |
| b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern; | 0.00 | 0.00 |
| c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden. | 0.00 | 0.00 |

Devisenkurse

| | | |
|-----|---------|------------|
| EUR | 1 = CHF | 0.99395514 |
|-----|---------|------------|

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

| Klasse | Währung | Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30) | | Durchschnitt Ausgabespesen in % | Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30) | | Durchschnitt Rücknahmespesen in % |
|---------------|----------------|--|---------------------|--|--|---------------------|--|
| | | Teilvermögen | Fondsleitung | | Teilvermögen | Fondsleitung | |
| FA CHF | CHF | 0.00 - 0.45 | - | 0.245 | 0.00 - 0.07 | - | 0.001 |
| GT CHF | CHF | 0.00 - 0.45 | - | 0.245 | 0.00 - 0.07 | - | 0.001 |
| NT CHF | CHF | 0.00 - 0.45 | - | 0.245 | 0.00 - 0.07 | - | 0.001 |

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

| Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten | Währung | Betrag |
|--|---------|--------|
| Keine | CHF | - |

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

| Klasse | PVK p.a. in % | | PMF p.a. in % | PAF p.a. in % | VK Zielfonds p.a. in % |
|--------|---------------|-------|---------------|---------------|------------------------|
| | Eff | Max | Eff | Eff | Eff |
| FA CHF | 0.180 | 0.500 | 0.080 | 0.100 | 3.000 |
| GT CHF | 0.110 | 0.350 | 0.060 | 0.050 | 3.000 |
| NT CHF | - | - | - | - | 3.000 |

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

8 Benchmark

SBI® AAA-BBB 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 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| FA CHF | Nein | CHF | 0.65000 | 0.2275 | 0.42250 |

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| GT CHF | Nein | CHF | 0.63664 | 0.22282 | 0.41382 |
| NT CHF | Nein | CHF | 0.73727 | 0.25804 | 0.47923 |

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 Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

(im Folgenden "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 USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
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 hedged CHF
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 hedged CHF

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA in Bezug auf die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF wie folgt zu ändern:

Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF

| Aktuelle Bezeichnung | Neue Bezeichnung |
|---|--------------------------------------|
| Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF | Swisscanto (CH) Index Commodity Fund |

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Commodity Fund) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 32 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex Bloomberg Commodity Index nach."

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass gegen die vorliegend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages keine Einwendungen erhoben werden können, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 15. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich



Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

ein 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 USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

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 hedged CHF

(neu: 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, 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.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF wird umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Sodann werden bestehende Anteilsklassen umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Ausserdem sollen die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen neu einem Soft Closing unterzogen werden können (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Weiter wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen und beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. eine Präzisierung bei der bestehenden Gating-Bestimmung vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 6 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

1. Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF

| Aktuelle Bezeichnung | Neue Bezeichnung |
|--|---|
| Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF | Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked |

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds

lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-JPY World Inflation-Linked Securities Index nach."

2. Umbenennung von Anteilsklassen

Die bestehenden Anteilsklassen mit Währungsabsicherung der Teilvermögen werden wie folgt umbenannt (vgl. § 6 Ziff. 4 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages):

| Bisherige Anteilsklassenbezeichnung | Neue Anteilsklassenbezeichnung |
|--|---------------------------------------|
| FTH CHF | FTH1 CHF |
| FTH EUR | FTH1 EUR |
| FTH GBP | FTH1 GBP |
| FTH USD | FTH1 USD |
| FAH CHF | FAH1 CHF |
| FAH EUR | FAH1 EUR |
| FAH GBP | FAH1 GBP |
| FAH USD | FAH1 USD |
| CTH CHF | CTH1 CHF |
| CTH EUR | CTH1 EUR |
| CTH GBP | CTH1 GBP |
| CTH USD | CTH1 USD |
| CAH CHF | CAH1 CHF |
| CAH EUR | CAH1 EUR |
| CAH GBP | CAH1 GBP |
| CAH USD | CAH1 USD |
| DTH CHF | DTH1 CHF |
| DTH EUR | DTH1 EUR |
| DTH GBP | DTH1 GBP |
| DTH USD | DTH1 USD |
| DAH CHF | DAH1 CHF |
| DAH EUR | DAH1 EUR |
| DAH GBP | DAH1 GBP |

| | |
|---------|----------|
| DAH USD | DAH1 USD |
| GTH CHF | GTH1 CHF |
| GTH EUR | GTH1 EUR |
| GTH GBP | GTH1 GBP |
| GTH USD | GTH1 USD |
| GAH CHF | GAH1 CHF |
| GAH EUR | GAH1 EUR |
| GAH GBP | GAH1 GBP |
| GAH USD | GAH1 USD |
| MTH CHF | MTH1 CHF |
| MTH EUR | MTH1 EUR |
| MTH GBP | MTH1 GBP |
| MTH USD | MTH1 USD |
| MAH CHF | MAH1 CHF |
| MAH EUR | MAH1 EUR |
| MAH GBP | MAH1 GBP |
| MAH USD | MAH1 USD |
| NTH CHF | NTH1 CHF |
| NTH EUR | NTH1 EUR |
| NTH GBP | NTH1 GBP |
| NTH USD | NTH1 USD |
| NAH CHF | NAH1 CHF |
| NAH EUR | NAH1 EUR |
| NAH GBP | NAH1 GBP |
| NAH USD | NAH1 USD |
| STH CHF | STH1 CHF |
| STH EUR | STH1 EUR |
| STH GBP | STH1 GBP |

| | |
|---------|----------|
| STH USD | STH1 USD |
| SAH CHF | SAH1 CHF |
| SAH EUR | SAH1 EUR |
| SAH GBP | SAH1 GBP |
| SAH USD | SAH1 USD |

3. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben. Vorbehalten bleiben die durch die Aufsichtsbehörde gewährten Ausnahmen."

4. Soft Closing

Für die Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect**, **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect** und **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Soft Closing aufgenommen (vgl. neue Ziff. 8 in § 5 des Fondsvertrages).

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können einem "Soft Closing" unterzogen werden, wonach Anleger keine Anteile zeichnen können, wenn die Schließung nach Auffassung der Fondsleitung notwendig ist, um die Interessen der bestehenden Anleger zu schützen. Das Soft Closing gilt in Bezug auf die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder Anteilsklassen dieser Teilvermögen für neue Zeichnungen oder Wechsel in das jeweilige Teilvermögen oder die jeweilige Anteilsklasse, jedoch nicht für Rücknahmen, Übertragungen oder Wechsel aus dem jeweiligen Teilvermögen oder der jeweiligen Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens heraus. Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können ohne Benachrichtigung der Anleger einem Soft Closing unterzogen werden.

5. Gating

Für das Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (vgl. neue Ziff. 10 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. Gleichsam behält sich die Fondsleitung beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang)

an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. 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. Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge stattfindet.

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.

Beim Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.** besteht bereits eine Bestimmung betreffend Gating, welche neu leicht präzisiert wird (vgl. bestehende Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto 15% des Fondsvermögens übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahmeaufträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. 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.

6. Keine Regelung der Umwandlung mehr

Bisher wurde in § 25 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 25 des Fondsvertrages und in § 25 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 – 5 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die 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.

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 3 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Juni 2022

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"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

Zurzeit 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, 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.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible soll repositioniert werden und neu unter anderem als Dachfonds ausgerichtet werden, was insbesondere mit Änderungen der Anlagepolitik, Risikoverteilung und mit Anpassungen bei der Bestimmung betreffend die Laufzeit der Teilvermögen und Auflösung verbunden ist (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem sollen 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 künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

Schliesslich soll das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible umbenannt werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

1 Repositionierung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible

In § 8 Ziff. 15 des Fondsvertrages ist geregelt, dass das Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex MSCI World ex Switzerland Index nachbildet. Neu wird diese Bestimmung ergänzt, in dem ausgeführt wird, dass dies mittels indirekten und direkten Anlagen erfolgen kann. In diesem Zusammenhang wird in § 18 Ziff. 15 lit. b des angepassten Fondsvertrages eine Limite aufgenommen, wonach die Fondsleitung höchstens 30% des Vermögens des Teilvermögens direkt investieren darf. Betreffend diese Investitionen geltend die Bestimmungen gemäss lit. ba – bd des angepassten Fondsvertrages.

Zudem wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen in die Swisscanto-Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible investieren kann (vgl. die Anpassungen in lit. a von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags). Ebenfalls wird unter der gleichen Bestimmung neu normiert, dass Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Ebenfalls wird in lit. b von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags die Bestimmung gestrichen, wonach die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen.

Das Teilvermögen soll zudem neu als Dachfonds ausgestaltet werden, welches in diverse Swisscanto-Zielfonds investieren kann (betreffend Zielfonds siehe dazu auch die Ausführungen unter nachstehender Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Einhergehend mit der Repositionierung zum Dachfonds wird in Ziff. 13 von § 15 des Fondsvertrages auch für das Teilvermögen insbesondere eine entsprechende Ergänzung aufgenommen, wonach die in Ziff. 13 erwähnte Grenze von 25% der Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen auf 100% angehoben ist für die Investitionen in die Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

Zudem findet künftig für das Teilvermögen die Regelung in § 15 Ziff. 10 des Fondsvertrages, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss den vorstehenden Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners 20% des Vermögens nicht übersteigen dürfen, keine Anwendung mehr.

Abschliessend wird in Ziff. 12 von § 15 des Fondsvertrages für das Teilvermögen präzisiert, dass sich der Anteil der Anlagen in einen Swisscanto-Zielfonds am Vermögen des Teilvermögens nach der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens bestimmt. Zudem ist diese Gewichtung in Ziff. 5.3 des Prospektes ausgewiesen (für den dort genannten Zeitpunkt).

Zusätzlich erfolgt der Hinweis, dass im Rahmen der Nachbildung des Referenzindex überdies die Gewichtung eines Swisscanto-Zielfonds (aufgrund der Berücksichtigung der Direktanlagenquote von höchstens 20% bzw. 30%) bis zu 15 Prozentpunkte von der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens abweichen kann.

In Zusammenhang mit der Ausgestaltung zum Dachfonds werden in § 1 Ziff. 5, § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 10, Ziff. 12, 13 und Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages diverse Anpassungen vorgenommen.

2 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 Zielfonds

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 sollen neu als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll zudem ergänzend als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I) mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible zudem neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieses Teilvermögen bis zu 100% der Anteile der Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible erwerben darf (vgl. in diesem Zusammenhang auch die entsprechenden Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung betreffend die Repositionierung zum Dachfonds beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible).

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds), für welche 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 Zielfonds fungieren, soll (wie bereits erwähnt) gemäss der Risikoverteilungsvorschrift jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für das Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden 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 jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Entsprechende Hinweise bzw. Ergänzungen werden in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll wie folgt geändert werden:

| Aktuelle Bezeichnung | Neue Bezeichnung |
|--|--|
| Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible | Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible |

Die Bezeichnung des Teilvermögens wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst.

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, der Jahres- und Halbjahresbericht, das Basisinformationsblatt sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 16. Januar 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich