

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX CHF) AGGREGATE RESPONSIBLE

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
NT CHF	116537818	CHF
NTH1 CHF	116076581	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegefügte Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	80
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	80
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	80
7	Pauschale Verwaltungskommission	81
8	Benchmark	81
9	TER	81
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	81
11	Fussnoten	82
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	83
13	Pflichtpublikationen	85

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	25.02.2022
	bis	29.02.2024	28.02.2023
Konsolidiert			
CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		956'852'817.35	549'939'980.17
Klasse NT CHF			
CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		61'368'556.67	84'185'378.26
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		722'742.000	951'301.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.9107	88.4950
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		96.4292	94.4198
Thesaurierung je Anteil		2.05	1.96
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.03 %	0.03 %
Klasse NTH1 CHF			
CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		895'484'260.68	465'754'601.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'049'436.098	5'221'770.242
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89.1079	89.1948
Thesaurierung je Anteil		2.14	1.95
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.03 %	0.03 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022
Klasse NT CHF (Lancierung 25.02.2022)	-3.28 %	-4.06 %	-12.50 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 25.02.2022)	0.67 %	2.30 %	-10.85 %
Benchmark Hedge	0.94 %	2.49 %	-11.00 %
Benchmark	-3.18 %	-3.89 %	-12.75 %
Tracking Error 33)	0.18 %	0.14 %	0.58 %

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 NT CHF (Lancierung 25.02.2022)	-0.10 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 25.02.2022)	-0.27 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	36'444'736.16	49'465'130.81
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	540'442'032.75	398'425'846.10
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	395'702'292.70	229'516'728.05
Derivative Finanzinstrumente	4'776.46	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5'215'772.73	3'379'026.81
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	977'809'610.80	680'786'731.77
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-20'956'793.45	-130'846'751.60
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	956'852'817.35	549'939'980.17

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2023	Lancierung 25.02.2022
		29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		951'301.000	-
Ausgegebene Anteile		578'135.867	967'121.000
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		52'482.133	-
Zurückgenommene Anteile		-859'177.000	-15'820.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		722'742.000	951'301.000

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2023	25.02.2022
		29.02.2024	28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'221'770.242	-
Ausgegebene Anteile		5'007'527.655	5'246'581.869
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		430'570.007	7'116.477
Zurückgenommene Anteile		-610'431.806	-31'928.104
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		10'049'436.098	5'221'770.242

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	30.11.2023	3'129'861.45	37'855.671
Klasse NT CHF	30.11.2023	1'209'298.33	14'626.462
Klasse NTH1 CHF	28.02.2023	34'378'005.42	385'426.117
Klasse NTH1 CHF	28.02.2023	4'026'600.24	45'143.890

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023	25.02.2022
		29.02.2024	28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		549'939'980.17	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-6'221'431.23	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr		409'108'981.87	602'398'075.58
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		4'025'286.54	-52'458'095.41
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		956'852'817.35	549'939'980.17

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	25.02.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		116'045.37	11'141.89
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-71'463.45	-5'713.52
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		11'290'845.50	5'474'278.80
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		8'908'645.90	4'683'354.71
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'443'053.63	1'935'175.13
Total Ertrag		25'687'126.95	12'098'237.01
Aufwand			
Passivzinsen		-10'030.05	-29.05
Sonstige Aufwendungen		-111.60	-11.65
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'653'612.76	-44'193.13
Total Aufwand		-2'663'754.41	-44'233.83
Nettoertrag / Verlust		23'023'372.54	12'054'003.18
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		9'498'479.12	-530'624.73
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		168'512.11	0.00
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		1'255'972.35	1'451'918.88
Realisierter Erfolg		33'946'336.12	12'975'297.33
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-29'921'049.58	-65'433'392.74
Gesamterfolg		4'025'286.54	-52'458'095.41

Verwendung des Erfolges

Klasse NT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	1'483'778.98	1'865'106.89
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'483'778.98	1'865'106.89
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	519'322.64	652'787.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	964'456.34	1'212'319.48
Total	1'483'778.98	1'865'106.89
<hr/>		
Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	21'539'593.56	10'188'896.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	21'539'593.56	10'188'896.29
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'538'857.75	3'566'113.70
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	14'000'735.81	6'622'782.59
Total	21'539'593.56	10'188'896.29

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							653'664'043.77	66.85	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							540'442'032.75	55.27	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	629	0	0	629 AUD	92.38%	333'175.51	0.03	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	130	120	0	250 AUD	79.87%	114'490.55	0.01	a)
AU0000042004	2.5000 % TCV 2 1/2 10/22/29 MTN	80	100	0	180 AUD	91.09%	94'012.98	0.01	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	657	190	80	767 AUD	84.35%	370'967.71	0.04	a)
AU0000048274	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/34	60	110	0	170 AUD	77.57%	75'612.67	0.01	a)
AU0000075624	1.0000 % TCV 1 11/20/23	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	679	0	0	679 AUD	80.47%	313'264.98	0.03	a)
AU0000078552	1.5000 % TCV 1 1/2 11/20/30	130	60	0	190 AUD	83.01%	90'428.10	0.01	a)
AU0000079402	1.7500 % QTC 1 3/4 07/20/34	40	0	0	40 AUD	75.36%	17'283.67	0.00	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	547	0	547	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000085631	1.2500 % TCV 1 1/4 11/19/27 MTN	50	100	0	150 AUD	90.27%	77'638.90	0.01	a)
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	370	290	0	660 AUD	82.59%	312'521.70	0.03	a)
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	417	330	0	747 AUD	94.16%	403'298.61	0.04	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	322	70	0	392 AUD	56.92%	127'929.52	0.01	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	391	360	0	751 AUD	80.06%	344'756.36	0.04	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	357	280	0	637 AUD	92.28%	337'040.49	0.03	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	281	260	0	541 AUD	82.89%	257'103.67	0.03	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	230	200	0	430 AUD	90.98%	224'298.09	0.02	a)
AU0000249302	3.7500 % ACGB 3 3/4 05/21/34 167	323	0	0	323 AUD	96.71%	179'105.52	0.02	a)
AU0000274706	3.5000 % ACGB 3 1/2 12/21/34 168	0	340	0	340 AUD	94.20%	183'638.99	0.02	a)
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	130	0	130 AUD	104.31%	77'748.47	0.01	a)
AU0000KFWHX0	5.0000 % KFW 5 03/19/24 MTN	30	0	0	30 AUD	100.02%	17'204.54	0.00	a)
AU0000XQLQU0	5.7500 % QTC 5 3/4 07/22/24 24	90	0	0	90 AUD	100.54%	51'883.52	0.01	a)
AU0000XQLQZ9	4.7500 % QTC 4 3/4 07/21/25 25	80	0	0	80 AUD	100.79%	46'231.52	0.00	a)
AU0000XVG2B1	5.5000 % TCV 5 1/2 12/17/24 1224	60	0	0	60 AUD	100.92%	34'719.05	0.00	a)
AU0000XVGH14	3.0000 % TCV 3 10/20/28 MTN	100	70	0	170 AUD	95.07%	92'669.46	0.01	a)
AU0000XVGZ14	5.5000 % TCV 5 1/2 11/17/26	100	130	0	230 AUD	103.56%	136'565.93	0.01	a)
AU0000KFWHAA3	4.0000 % KFW 4 02/27/25 MTN	50	0	0	50 AUD	99.58%	28'547.53	0.00	a)
AU0000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	432	0	0	432 AUD	102.90%	254'869.17	0.03	a)
AU0000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	635	60	0	695 AUD	101.03%	402'612.65	0.04	a)
AU0000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	100	160	0	260 AUD	87.09%	129'824.53	0.01	a)
AU0000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	231	0	0	231 AUD	87.69%	116'141.44	0.01	a)
AU0000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	367	210	0	577 AUD	96.67%	319'827.70	0.03	a)
AU0000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	491	140	0	631 AUD	94.28%	341'090.94	0.03	a)
AU0000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	173	110	0	283 AUD	78.48%	127'351.08	0.01	a)
AU0000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	330	310	0	640 AUD	95.70%	351'174.07	0.04	a)
AU0000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	327	310	0	637 AUD	94.47%	345'039.18	0.04	a)
AU0000XQLQAA7	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/26 26	90	0	0	90 AUD	98.27%	50'710.57	0.01	a)
AU0000XQLQAB5	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/28 28	100	0	0	100 AUD	96.79%	55'495.92	0.01	a)
AU3CB0218691	4.7500 % IADB 4 3/4 08/27/24 MTN	30	0	0	30 AUD	100.14%	17'224.67	0.00	a)
AU3CB0220598	4.7500 % RENTEN 4 3/4 05/06/26 MTN	40	0	0	40 AUD	101.02%	23'169.43	0.00	a)
AU3CB0222040	4.2500 % IBRD 4 1/4 06/24/25 MTN	40	0	0	40 AUD	99.92%	22'916.23	0.00	a)
AU3CB0223816	3.7500 % ASIA 3 3/4 03/12/25 MTN	40	0	0	40 AUD	99.38%	22'793.30	0.00	a)
AU3CB0226637	3.2500 % BNG 3 1/4 07/15/25 MTN	30	0	0	30 AUD	98.41%	16'927.78	0.00	a)
AU3CB0234573	4.1250 % WSTP 4 1/8 06/04/26 MTN	0	500	200	300 AUD	98.87%	170'060.43	0.02	a)
AU3CB0235166	3.2000 % IFC 3.2 07/22/26 MTN	40	0	0	40 AUD	97.62%	22'388.50	0.00	a)
AU3CB0235612	3.1000 % EIB 3.1 08/17/26 MTN	50	0	0	50 AUD	97.40%	27'923.99	0.00	a)
AU3CB0243806	3.2000 % IFC 3.2 10/18/27 MTN	0	60	0	60 AUD	96.34%	33'143.78	0.00	a)
AU3CB0245504	4.0000 % MET 4 07/13/27 MTN	0	500	500	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0245884	3.3000 % EIB 3.3 02/03/28 MTN	30	0	0	30 AUD	96.35%	16'573.26	0.00	a)
AU3CB0246239	4.5000 % VZ 4 1/2 08/17/27 MTN	0	60	0	60 AUD	98.75%	33'971.49	0.00	a)
AU3CB0246999	3.2500 % RENTEN 3 1/4 04/12/28 MTN	30	0	0	30 AUD	95.84%	16'485.54	0.00	a)
AU3CB0248037	3.5000 % QTC 3 1/2 08/21/30	130	0	0	130 AUD	95.58%	71'244.28	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AU3CB0249373	4.2000 % VOD 4.2 12/13/27 MTN	40	0	0	40 AUD	97.03%	22'254.10	0.00	a)
AU3CB0249928	3.3000 % BNG 3.3 07/17/28 MTN	30	0	0	30 AUD	95.40%	16'410.03	0.00	a)
AU3CB0250215	3.4500 % NEDWBK 3.45 07/17/28 MTN	40	0	40	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0250520	3.3000 % ASIA 3.3 08/08/28 MTN	30	0	0	30 AUD	95.69%	16'458.88	0.00	a)
AU3CB0254910	3.1500 % IFC 3.15 06/26/29 MTN	30	0	0	30 AUD	93.81%	16'135.84	0.00	a)
AU3CB0256907	4.1000 % T 4.1 01/19/26	0	600	300	300 AUD	98.63%	169'652.77	0.02	a)
AU3CB0258028	3.3000 % BNG 3.3 04/26/29 MTN2	0	50	0	50 AUD	94.14%	26'988.25	0.00	a)
AU3CB0259919	2.4500 % ASIA 2.45 01/17/24	30	0	30	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0261212	2.2000 % IBRD 2.2 02/27/24	0	600	600	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0263945	1.7000 % EIB 1.7 11/15/24 MTN	20	0	0	20 AUD	98.12%	11'252.16	0.00	a)
AU3CB0265007	1.4500 % IFC 1.45 07/22/24	30	0	0	30 AUD	98.86%	17'005.70	0.00	a)
AU3CB0266484	1.0000 % NSWTC 1 02/08/24	80	0	80	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0268548	2.4500 % LOFINA 2.45 11/20/26 MTN	50	0	50	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0269710	1.6500 % ANZ 1.65 01/16/25 MTN	50	0	0	50 AUD	97.46%	27'940.33	0.00	a)
AU3CB0271914	1.5000 % IFC 1 1/2 04/15/35 MTN	0	50	0	50 AUD	70.28%	20'148.23	0.00	a)
AU3CB0271955	2.2500 % TCV 2 1/4 11/20/41 MTN	40	40	0	80 AUD	64.72%	29'686.35	0.00	a)
AU3CB0271989	2.2500 % QTC 2 1/4 11/20/41	100	0	0	100 AUD	65.80%	37'725.46	0.00	a)
AU3CB0272854	4.5000 % BACAU 4 1/2 12/30/30 MTN	0	50	0	50 AUD	94.07%	26'967.60	0.00	a)
AU3CB0272904	1.4100 % HOUAUS 1.41 06/29/32 MTN	0	50	0	50 AUD	78.54%	22'516.25	0.00	a)
AU3CB0275998	1.1000 % IBRD 1.1 11/18/30 MTN	25	0	0	25 AUD	79.80%	11'439.02	0.00	a)
AU3CB0276004	0.5000 % IBRD 0 1/2 05/18/26 MTN	30	0	0	30 AUD	92.15%	15'849.96	0.00	a)
AU3CB0276509	1.0000 % NBNAUS 1 12/03/25 MTN	30	0	0	30 AUD	93.66%	16'109.87	0.00	a)
AU3CB0277291	1.3000 % EIB 1.3 01/27/31 MTN	50	0	0	50 AUD	79.96%	22'924.20	0.00	a)
AU3CB0277432	1.0000 % IADB 1 08/04/28 MTN	30	0	0	30 AUD	86.40%	14'861.93	0.00	a)
AU3CB0278174	1.1000 % UBS 1.1 02/26/26	50	0	0	50 AUD	92.70%	26'574.85	0.00	a)
AU3CB0278711	3.7000 % LLCAU 3.7 03/31/31 MTN	40	0	0	40 AUD	80.97%	18'569.39	0.00	a)
AU3CB0280634	2.1500 % NBNAUS 2.15 06/02/28 MTN	50	0	0	50 AUD	89.46%	25'646.27	0.00	a)
AU3CB0280907	1.1000 % AFDB 1.1 12/16/26	40	0	0	40 AUD	91.43%	20'969.29	0.00	a)
AU3CB0282523	1.4000 % VW 1.4 08/25/25 MTN	60	0	60	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0282812	3.8000 % PNHAU 3.8 09/08/31 MTN	30	0	0	30 AUD	82.02%	14'108.52	0.00	a)
AU3CB0283182	3.1500 % QANAU 3.15 09/27/28 MTN	30	0	30	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0283406	1.8500 % WOWAU 1.85 11/15/27 MTN	50	0	0	50 AUD	90.49%	25'940.70	0.00	a)
AU3CB0284172	2.0000 % QTC 2 08/22/33	60	0	0	60 AUD	79.66%	27'404.11	0.00	a)
AU3CB0285807	1.9000 % AIIB 1.9 01/18/27 MTN	40	0	0	40 AUD	93.09%	21'348.86	0.00	a)
AU3CB0286037	2.4000 % WSTP 2.4 01/25/27 MTN	100	0	0	100 AUD	93.87%	53'822.83	0.01	a)
AU3CB0286136	2.0000 % KFW 2 02/15/27 MTN	30	0	0	30 AUD	93.72%	16'121.05	0.00	a)
AU3CB0286763	2.9000 % NAB 2.9 02/25/27 MTN	50	0	0	50 AUD	95.06%	27'252.00	0.00	a)
AU3CB0286789	2.3500 % NAB 2.35 02/25/25 MTN	50	0	0	50 AUD	97.82%	28'042.96	0.00	a)
AU3CB0290096	5.3906 % LLOYDS 5.3906 06/10/27 MTN	40	40	0	40 AUD	100.43%	23'034.34	0.00	a)
AU3CB0291136	4.5000 % TD 4 1/2 07/28/25	200	0	0	200 AUD	99.81%	114'460.73	0.01	a)
AU3CB0291466	5.9060 % ANZ 5.906 08/12/32	40	0	0	40 AUD	101.39%	23'253.37	0.00	a)
AU3CB0291847	3.6000 % IFC 3.6 02/24/26 MTN	0	40	0	40 AUD	98.69%	22'635.28	0.00	a)
AU3CB0294270	4.1000 % KFW 4.1 02/20/26 MTN	50	0	0	50 AUD	99.69%	28'579.06	0.00	a)
AU3CB0294957	4.8000 % SUNAU 4.8 12/14/27 MTN	40	0	0	40 AUD	99.66%	22'857.74	0.00	a)
AU3CB0295582	5.0000 % CBAAU 5 01/13/28 MTN	0	200	0	200 AUD	101.01%	115'828.79	0.01	a)
AU3CB0296598	4.2000 % KFW 4.2 02/08/29 MTN	0	70	0	70 AUD	99.12%	39'784.32	0.00	a)
AU3CB0296671	6.7360 % ANZ 6.736 02/10/38	0	40	0	40 AUD	104.91%	24'060.67	0.00	a)
AU3CB0296754	4.2000 % EIB 4.2 08/21/28	0	40	0	40 AUD	99.39%	22'794.21	0.00	a)
AU3CB0297554	6.1630 % NAB 6.163 03/09/33 MTN	0	50	0	50 AUD	102.14%	29'280.87	0.00	a)
AU3CB0297802	5.8020 % LLOYDS 5.802 03/17/29 MTN	0	40	0	40 AUD	101.37%	23'248.78	0.00	a)
AU3CB0302594	5.0000 % TOYOTA 5 09/15/26 MTN	0	50	0	50 AUD	100.52%	28'818.16	0.00	a)
AU3CB0302867	4.7000 % IADB 4.7 10/03/30 MTN	0	30	0	30 AUD	100.34%	17'259.24	0.00	a)
AU3CB0303451	4.6000 % IFC 4.6 10/19/28	0	60	0	60 AUD	101.03%	34'757.24	0.00	a)
AU3CB0304434	5.4000 % NAB 5.4 11/16/28 MTN	0	60	0	60 AUD	102.58%	35'289.10	0.00	a)
AU3CB0306330	4.7500 % ANZ 4 3/4 02/05/27 MTN	0	60	0	60 AUD	100.22%	34'478.58	0.00	a)
AU3CB0306348	4.9500 % ANZ 4.95 02/05/29 MTN	0	60	0	60 AUD	100.60%	34'610.00	0.00	a)
AU3SG0000417	5.0000 % NSWTC 5 08/20/24 24	40	0	0	40 AUD	100.32%	23'007.74	0.00	a)
AU3SG0001175	4.2500 % TCV 4 1/4 12/20/32	100	140	0	240 AUD	96.71%	133'076.00	0.01	a)
AU3SG0001241	5.0000 % WATC 5 07/23/25 25	40	0	0	40 AUD	101.12%	23'192.36	0.00	a)
AU3SG0001373	4.0000 % NSWTC 4 05/20/26 26	50	40	0	90 AUD	99.95%	51'575.96	0.01	a)
AU3SG0001464	3.2500 % TASCOR 3 1/4 02/19/26 26	0	20	0	20 AUD	98.46%	11'291.15	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AU3SG0001498	3.0000 % SAFA 3 07/20/26 26	50	0	0	50 AUD	97.69%	28'005.40	0.00	a)
AU3SG0001514	3.0000 % NSWTC 3 03/20/28	95	90	0	185 AUD	96.08%	101'913.27	0.01	a)
AU3SG0001563	3.0000 % WATC 3 10/21/27 27	40	60	0	100 AUD	96.57%	55'369.21	0.01	a)
AU3SG0001571	3.0000 % NSWTC 3 02/20/30	120	70	0	190 AUD	93.31%	101'650.04	0.01	a)
AU3SG0001605	2.7500 % QTC 2 3/4 08/20/27 27	80	0	0	80 AUD	95.93%	44'004.09	0.00	a)
AU3SG0001621	2.2500 % SAFA 2 1/4 08/15/24 24	50	0	0	50 AUD	99.10%	28'411.06	0.00	a)
AU3SG0001639	2.5000 % WATC 2 1/2 07/23/24 24	70	0	0	70 AUD	99.31%	39'860.18	0.00	a)
AU3SG0001696	3.0000 % NSWTC 3 05/20/27 27	90	80	0	170 AUD	96.96%	94'512.67	0.01	a)
AU3SG0001704	3.0000 % WATC 3 10/21/26 26	50	0	0	50 AUD	97.49%	27'949.79	0.00	a)
AU3SG0001720	3.0000 % NSWTC 3 04/20/29 29	110	70	0	180 AUD	94.69%	97'726.35	0.01	a)
AU3SG0001761	3.2500 % TASCOR 3 1/4 01/24/28	40	0	0	40 AUD	96.96%	22'236.67	0.00	a)
AU3SG0001829	3.2500 % WATC 3 1/4 07/20/28 28	40	0	0	40 AUD	96.81%	22'202.50	0.00	a)
AU3SG0001837	3.0000 % SAFA 3 05/24/28 28	50	50	0	100 AUD	95.86%	54'964.41	0.01	a)
AU3SG0001860	3.2500 % QTC 3 1/4 08/21/29	90	0	0	90 AUD	95.56%	49'312.12	0.01	a)
AU3SG0001878	3.0000 % NSWTC 3 11/15/28	0	30	0	30 AUD	95.39%	16'408.82	0.00	a)
AU3SG0001886	2.7500 % NTTC 2 3/4 04/21/27	100	0	0	100 AUD	96.15%	55'128.96	0.01	a)
AU3SG0001910	2.7500 % WATC 2 3/4 07/24/29 29	40	0	0	40 AUD	93.26%	21'389.00	0.00	a)
AU3SG0001944	2.0000 % NSWTC 2 03/20/31	70	160	0	230 AUD	85.43%	112'659.60	0.01	a)
AU3SG0001969	1.2500 % AUSCAP 1 1/4 05/22/25	40	0	0	40 AUD	96.50%	22'131.63	0.00	a)
AU3SG0001985	2.0000 % WATC 2 10/24/34	0	60	0	60 AUD	77.57%	26'684.76	0.00	a)
AU3SG0001993	1.7500 % QTC 1 3/4 08/21/31	50	0	0	50 AUD	83.14%	23'836.14	0.00	a)
AU3SG0002058	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/32	50	60	0	110 AUD	80.63%	50'851.39	0.01	a)
AU3SG0002082	2.0000 % NSWTC 2 03/08/33	70	150	0	220 AUD	80.37%	101'376.08	0.01	a)
AU3SG0002165	2.2500 % NSWTC 2 1/4 05/07/41	50	0	0	50 AUD	66.23%	18'988.30	0.00	a)
AU3SG0002199	1.7500 % WATC 1 3/4 10/22/31	30	60	0	90 AUD	82.85%	42'755.41	0.00	a)
AU3SG0002249	2.2500 % NSWTC 2 1/4 11/20/40	40	0	0	40 AUD	66.82%	15'324.12	0.00	a)
AU3SG0002256	2.0000 % TCV 2 11/20/37 MTN	0	80	0	80 AUD	68.54%	31'439.03	0.00	a)
AU3SG0002314	1.5000 % TCV 1 1/2 09/10/31 MTN	100	100	0	200 AUD	80.59%	92'416.94	0.01	a)
AU3SG0002348	1.2500 % NSWTC 1 1/4 11/20/30	40	0	0	40 AUD	82.23%	18'858.60	0.00	a)
AU3SG0002389	1.5000 % NSWTC 1 1/2 02/20/32	120	120	0	240 AUD	79.69%	109'664.61	0.01	a)
AU3SG0002421	0.5000 % TCV 0 1/2 11/20/25 MTN	50	90	0	140 AUD	94.00%	75'456.31	0.01	a)
AU3SG0002439	1.5000 % QTC 1 1/2 08/20/32	50	1'200	0	1'250 AUD	78.68%	563'902.36	0.06	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	45	50	0	95 AUD	75.21%	40'968.64	0.00	a)
AU3SG0002454	1.5000 % WATC 1 1/2 10/22/30	30	70	0	100 AUD	84.03%	48'178.00	0.00	a)
AU3SG0002504	2.2500 % TCV 2 1/4 09/15/33	50	200	0	250 AUD	80.40%	115'248.83	0.01	a)
AU3SG0002512	1.7500 % AUSCAP 1 3/4 05/17/30	30	40	0	70 AUD	85.94%	34'492.80	0.00	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	40	160	0	200 AUD	75.84%	86'972.22	0.01	a)
AU3SG0002561	1.5000 % QTC 1 1/2 03/02/32	40	0	0	40 AUD	80.06%	18'362.29	0.00	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCV 2 09/17/35	40	80	0	120 AUD	73.52%	50'583.63	0.01	a)
AU3SG0002611	2.5000 % AUSCAP 2 1/2 10/22/32 MTN	30	0	0	30 AUD	84.87%	14'597.89	0.00	a)
AU3SG0002629	2.5000 % NSWTC 2 1/2 11/22/32	40	0	0	40 AUD	85.00%	19'494.13	0.00	a)
AU3SG0002702	4.7500 % NSWTC 4 3/4 02/20/35	40	110	0	150 AUD	99.01%	85'152.34	0.01	a)
AU3SG0002710	4.7500 % TCV 4 3/4 09/15/36 MTN	80	50	0	130 AUD	96.82%	72'167.80	0.01	a)
AU3SG0002728	4.2500 % NSWTC 4 1/4 02/20/36	0	90	0	90 AUD	93.55%	48'275.41	0.00	a)
AU3SG0002751	4.7500 % SAFA 4 3/4 05/24/38	0	50	0	50 AUD	95.77%	27'454.68	0.00	a)
AU3SG0002777	4.0000 % TASCOR 4 01/20/34 MTN	0	60	0	60 AUD	94.01%	32'341.17	0.00	a)
AU3SG0002876	5.2500 % AUSCAP 5 1/4 10/24/33	0	60	0	60 AUD	103.92%	35'751.81	0.00	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	190	0	190	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	607	100	0	707 AUD	103.05%	417'744.66	0.04	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	300	0	300	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	636	100	100	636 AUD	97.49%	355'521.29	0.04	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	550	140	0	690 AUD	99.22%	392'535.56	0.04	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	114	170	0	284 AUD	94.82%	154'402.15	0.02	a)
AUD							13'314'034.54	1.36	
CA007863AL73	3.0300 % AERMON 3.03 04/21/50 R	0	150	0	150 CAD	75.75%	73'769.88	0.01	a)
CA00889YAE10	2.1950 % AIREIN 2.195 11/04/26	50	0	0	50 CAD	93.98%	30'506.17	0.00	a)
CA013051DK06	3.4500 % ALTA 3.45 12/01/43	0	50	0	50 CAD	87.22%	28'310.56	0.00	a)
CA013051DM61	3.1000 % ALTA 3.1 06/01/24	40	0	0	40 CAD	99.52%	25'844.36	0.00	a)
CA013051DQ75	2.3500 % ALTA 2.35 06/01/25	40	0	0	40 CAD	97.31%	25'270.46	0.00	a)
CA013051DS32	3.3000 % ALTA 3.3 12/01/46	110	0	0	110 CAD	84.17%	60'106.57	0.01	a)
CA013051DT15	2.2000 % ALTA 2.2 06/01/26	50	0	0	50 CAD	95.68%	31'056.70	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA013051DW44	2.5500 % ALTA 2.55 06/01/27	100	0	0	100 CAD	95.53%	62'019.26	0.01	a)
CA013051DY00	3.0500 % ALTA 3.05 12/01/48	75	50	0	125 CAD	79.80%	64'759.88	0.01	a)
CA013051EB97	2.9000 % ALTA 2.9 12/01/28	40	50	0	90 CAD	95.51%	55'802.14	0.01	a)
CA013051ED53	3.1000 % ALTA 3.1 06/01/50	145	0	0	145 CAD	80.48%	75'761.58	0.01	a)
CA013051EG84	2.0500 % ALTA 2.05 06/01/30	150	0	0	150 CAD	89.39%	87'052.63	0.01	a)
CA013051EP83	1.6500 % ALTA 1.65 06/01/31	60	50	0	110 CAD	85.15%	60'809.98	0.01	a)
CA013051EQ66	2.9500 % ALTA 2.95 06/01/52	60	0	0	60 CAD	78.08%	30'413.59	0.00	a)
CA013051ER40	4.1500 % ALTA 4.15 06/01/33	40	40	0	80 CAD	99.95%	51'908.92	0.01	a)
CA014443AL94	1.7510 % ALCTRA 1.751 02/11/31	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA014443AM77	5.2250 % ALCTRA 5.225 11/14/52	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA02138ZAW38	2.0750 % ALACN 2.075 05/30/28 MTN	0	60	0	60 CAD	89.79%	34'974.91	0.00	a)
CA037833CY47	2.5130 % AAPL 2.513 08/19/24 MPLE	40	0	0	40 CAD	98.89%	25'679.46	0.00	a)
CA045167FA66	0.7500 % ASIA 0 3/4 02/10/26 GMTN	40	0	0	40 CAD	93.32%	24'234.33	0.00	a)
CA045167FD06	1.5000 % ASIA 1 1/2 05/04/28	40	0	0	40 CAD	90.65%	23'539.42	0.00	a)
CA05554PAE30	2.5510 % BCIMCR 2.551 06/24/26 5	50	0	0	50 CAD	95.54%	31'012.88	0.00	a)
CA05590HBA47	0.9900 % BMW 0.99 01/14/25 X	50	0	0	50 CAD	96.72%	31'396.23	0.00	a)
CA060505FM13	2.9320 % BAC 2.932 04/25/25 MPLE	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA060505FZ26	1.9780 % BAC 1.978 09/15/27 MPLE	50	0	0	50 CAD	92.99%	30'186.11	0.00	a)
CA060505GF52	3.6150 % BAC 3.615 03/16/28	0	70	0	70 CAD	96.38%	43'798.85	0.00	a)
CA06368B2H05	2.8500 % BMO 2.85 03/06/24	50	0	0	50 CAD	99.99%	32'457.03	0.00	a)
CA06368BTX69	3.1900 % BMO 3.19 03/01/28 DPNT	50	0	0	50 CAD	95.72%	31'069.68	0.00	a)
CA06368D3U60	4.3090 % BMO 4.309 06/01/27	40	0	0	40 CAD	98.87%	25'674.52	0.00	a)
CA06368DCV43	2.3700 % BMO 2.37 02/03/25 MTN	50	0	0	50 CAD	97.60%	31'680.58	0.00	a)
CA06368DTH75	1.5510 % BMO 1.551 05/28/26	60	0	0	60 CAD	93.65%	36'479.64	0.00	a)
CA06368LEY89	4.7090 % BMO 4.709 12/07/27	50	0	0	50 CAD	100.02%	32'467.75	0.00	a)
CA06368LNK84	5.0390 % BMO 5.039 05/29/28	0	70	0	70 CAD	101.30%	46'033.35	0.00	a)
CA06369ZCF95	2.0770 % BMO 2.077 06/17/30	40	0	0	40 CAD	96.05%	24'943.00	0.00	a)
CA06369ZCG78	1.9280 % BMO 1.928 07/22/31	30	0	0	30 CAD	93.02%	18'117.12	0.00	a)
CA06369ZCJ18	6.0340 % BMO 6.034 09/07/33	0	40	0	40 CAD	103.51%	26'879.71	0.00	a)
CA064151S959	3.1000 % BNS 3.1 02/02/28 DPNT	60	0	0	60 CAD	95.44%	37'174.94	0.00	a)
CA06415GAZ33	1.9500 % BNS 1.95 01/10/25	80	0	0	80 CAD	97.42%	50'597.01	0.01	a)
CA06415GDE76	2.9500 % BNS 2.95 03/08/27	100	0	0	100 CAD	95.16%	61'778.40	0.01	a)
CA06415GDJ63	3.9340 % BNS 3.934 05/03/32	60	0	0	60 CAD	96.54%	37'605.75	0.00	a)
CA06415GH297	5.5000 % BNS 5 1/2 05/08/26	70	0	0	70 CAD	101.33%	46'046.98	0.00	a)
CA06415GM982	5.6790 % BNS 5.679 08/02/33	0	40	0	40 CAD	101.99%	26'484.99	0.00	a)
CA07813ZBY93	3.6000 % BCECN 3.6 09/29/27 MTN	70	0	0	70 CAD	96.72%	43'952.45	0.00	a)
CA07813ZBZ68	3.3500 % BCECN 3.35 03/12/25 MTN	50	0	0	50 CAD	98.26%	31'896.44	0.00	a)
CA07813ZCD48	3.5000 % BCECN 3 1/2 09/30/50	70	0	0	70 CAD	75.02%	34'093.75	0.00	a)
CA07813ZCE21	2.5000 % BCECN 2 1/2 05/14/30 MTN	40	0	0	40 CAD	88.19%	22'901.38	0.00	a)
CA07813ZCK80	5.8500 % BCECN 5.85 11/10/32	50	0	0	50 CAD	106.06%	34'428.67	0.00	a)
CA07813ZCL63	4.5500 % BCECN 4.55 02/09/30	0	60	0	60 CAD	98.93%	38'534.77	0.00	a)
CA07813ZCM47	5.1500 % BCECN 5.15 02/09/53	0	40	0	40 CAD	98.20%	25'500.54	0.00	a)
CA1107098Y17	4.3000 % BRCOL 4.3 06/18/42	115	0	0	115 CAD	99.03%	73'936.69	0.01	a)
CA110709AF97	1.5500 % BRCOL 1.55 06/18/31	90	50	0	140 CAD	84.45%	76'753.76	0.01	a)
CA110709AG70	2.7500 % BRCOL 2 3/4 06/18/52	0	90	0	90 CAD	75.46%	44'090.73	0.00	a)
CA110709FY32	4.9500 % BRCOL 4.95 06/18/40 BCCD	0	40	0	40 CAD	106.99%	27'782.10	0.00	a)
CA110709GC03	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/44	40	50	0	90 CAD	84.22%	49'208.49	0.01	a)
CA110709GF34	3.3000 % BRCOL 3.3 12/18/23	30	0	30	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA110709GH99	2.9500 % BRCOL 2.95 12/18/28	70	0	0	70 CAD	95.73%	43'503.46	0.00	a)
CA110709GJ55	2.9500 % BRCOL 2.95 06/18/50	115	0	0	115 CAD	78.76%	58'803.39	0.01	a)
CA110709GK29	2.2000 % BRCOL 2.2 06/18/30	90	0	0	90 CAD	90.14%	52'666.87	0.01	a)
CA110709GL02	3.2000 % BRCOL 3.2 06/18/32	50	0	0	50 CAD	93.65%	30'400.03	0.00	a)
CA110709GM84	4.2500 % BRCOL 4 1/4 12/18/53	0	40	0	40 CAD	100.14%	26'003.54	0.00	a)
CA11070TAF53	2.8500 % BRCOL 2.85 06/18/25	50	0	0	50 CAD	97.86%	31'764.01	0.00	a)
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	80	0	0	80 CAD	76.90%	39'940.17	0.00	a)
CA11070TAL22	2.5500 % BRCOL 2.55 06/18/27	40	50	0	90 CAD	95.52%	55'813.24	0.01	a)
CA11271ZAA99	5.4310 % BNCN 5.431 12/14/32 MTN	0	60	0	60 CAD	101.25%	39'440.80	0.00	a)
CA11282ZAM01	4.2500 % BAMREP 4 1/4 01/15/29 MTN	50	0	0	50 CAD	97.57%	31'671.17	0.00	a)
CA11282ZAS70	5.2920 % BAMREP 5.292 10/28/33	0	50	0	50 CAD	101.47%	32'936.80	0.00	a)
CA116705AJ37	4.0000 % BRUPOW 4 06/21/30 201	0	50	0	50 CAD	96.08%	31'186.21	0.00	a)
CA116705AK00	2.6800 % BRUPOW 2.68 12/21/28 211	50	0	0	50 CAD	91.72%	29'771.27	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA12593CAF82	3.0000 % CPPIBC 3 06/15/28 EMTN	0	250	0	250 CAD	96.26%	156'234.57	0.02	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	118	0	0	118 CAD	99.40%	76'144.32	0.01	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	97	50	0	147 CAD	87.73%	83'723.57	0.01	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	132	150	0	282 CAD	89.27%	163'437.42	0.02	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	145	80	0	225 CAD	97.36%	142'212.06	0.01	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	157	40	0	197 CAD	94.66%	121'060.15	0.01	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	283	0	0	283 CAD	91.88%	168'810.37	0.02	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	127	100	0	227 CAD	93.86%	138'318.22	0.01	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	792	140	0	932 CAD	75.25%	455'331.56	0.05	a)
CA135087H987	2.0000 % CAN 2 09/01/23	280	0	280	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	123	120	0	243 CAD	94.10%	148'452.45	0.02	a)
CA135087J546	2.2500 % CAN 2 1/4 03/01/24	92	0	0	92 CAD	100.00%	59'726.91	0.01	a)
CA135087J967	1.5000 % CAN 1 1/2 09/01/24	166	0	0	166 CAD	98.41%	106'050.30	0.01	a)
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	677	120	0	797 CAD	87.46%	452'512.08	0.05	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	354	0	0	354 CAD	96.82%	222'517.44	0.02	a)
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	715	0	0	715 CAD	94.51%	438'703.05	0.04	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	420	270	0	690 CAD	82.18%	368'113.40	0.04	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	494	60	0	554 CAD	92.74%	333'537.80	0.03	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	340	0	200	140 CAD	99.66%	90'577.94	0.01	a)
CA135087L930	1.0000 % CAN 1 09/01/26	435	0	0	435 CAD	93.11%	262'943.94	0.03	a)
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	694	100	0	794 CAD	87.23%	449'618.04	0.05	a)
CA135087M359	0.2500 % CAN 0 1/4 08/01/23	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	129	0	0	129 CAD	97.80%	81'903.40	0.01	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	481	130	0	611 CAD	69.99%	277'617.63	0.03	a)
CA135087M763	0.5000 % CAN 0 1/2 11/01/23	117	0	117	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	200	160	0	360 CAD	92.90%	217'124.99	0.02	a)
CA135087M920	0.7500 % CAN 0 3/4 02/01/24	171	0	171	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	330	220	0	550 CAD	86.46%	308'720.30	0.03	a)
CA135087N340	1.5000 % CAN 1 1/2 04/01/25	130	0	0	130 CAD	96.78%	81'680.84	0.01	a)
CA135087N423	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/24	100	0	0	100 CAD	99.46%	64'569.34	0.01	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	451	0	0	451 CAD	89.27%	261'375.17	0.03	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	80	0	0	80 CAD	93.71%	48'671.20	0.00	a)
CA135087N837	2.7500 % CAN 2 3/4 09/01/27	190	130	0	320 CAD	96.90%	201'311.90	0.02	a)
CA135087P246	3.0000 % CAN 3 10/01/25	150	0	0	150 CAD	97.94%	95'378.69	0.01	a)
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	240	120	0	360 CAD	92.46%	216'096.65	0.02	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	180	0	0	180 CAD	98.82%	115'478.09	0.01	a)
CA135087P576	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/28	231	40	0	271 CAD	99.46%	174'986.43	0.02	a)
CA135087P659	3.7500 % CAN 3 3/4 02/01/25	80	150	0	230 CAD	99.17%	148'077.95	0.02	a)
CA135087P816	3.0000 % CAN 3 04/01/26	0	160	0	160 CAD	97.86%	101'650.01	0.01	a)
CA135087P998	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/55	0	230	0	230 CAD	88.44%	132'053.22	0.01	a)
CA135087Q236	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/33	0	410	0	410 CAD	94.16%	250'616.40	0.03	a)
CA135087Q319	3.7500 % CAN 3 3/4 05/01/25	126	110	0	236 CAD	99.11%	151'853.52	0.02	a)
CA135087Q491	3.2500 % CAN 3 1/4 09/01/28	0	320	0	320 CAD	98.54%	204'702.31	0.02	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	410	0	410 CAD	98.06%	261'021.16	0.03	a)
CA135087Q988	4.0000 % CAN 4 03/01/29	0	240	0	240 CAD	101.93%	158'821.14	0.02	a)
CA135087R226	4.5000 % CAN 4 1/2 02/01/26	0	390	0	390 CAD	100.58%	254'648.56	0.03	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	140	80	0	220 CAD	110.58%	157'941.85	0.02	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	257	0	0	257 CAD	117.34%	195'780.24	0.02	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	151	50	0	201 CAD	115.88%	151'209.58	0.02	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	148	130	0	278 CAD	106.87%	192'869.05	0.02	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	294	0	0	294 CAD	101.02%	192'815.19	0.02	a)
CA13509PEF68	2.9000 % CANHOU 2.9 06/15/24	130	0	130	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13509PER07	2.5500 % CANHOU 2.55 03/15/25	120	0	0	120 CAD	97.91%	76'278.80	0.01	a)
CA13509PFA62	1.9500 % CANHOU 1.95 12/15/25	220	0	0	220 CAD	95.92%	136'997.96	0.01	a)
CA13509PFL28	1.9000 % CANHOU 1.9 09/15/26	130	0	0	130 CAD	94.75%	79'961.68	0.01	a)
CA13509PFX65	2.3500 % CANHOU 2.35 06/15/27	180	60	0	240 CAD	95.08%	148'135.73	0.02	a)
CA13509PGL19	2.6500 % CANHOU 2.65 03/15/28 FEB	40	60	0	100 CAD	95.53%	62'019.26	0.01	a)
CA13509PGS61	2.6500 % CANHOU 2.65 12/15/28	90	40	0	130 CAD	95.00%	80'172.67	0.01	a)
CA13509PGU18	2.5500 % CANHOU 2.55 12/15/23 SEPT	120	0	120	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13509PHD83	2.1000 % CANHOU 2.1 09/15/29	110	0	0	110 CAD	91.63%	65'438.24	0.01	a)
CA13509PHJ53	1.8000 % CANHOU 1.8 12/15/24	110	0	0	110 CAD	97.73%	69'792.98	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA13509PHM82	1.7500 % CANHOU 1 3/4 06/15/30	120	50	0	170 CAD	88.61%	97'793.28	0.01	a)
CA13509PHN65	0.9500 % CANHOU 0.95 06/15/25 MAR	120	50	0	170 CAD	95.56%	105'464.75	0.01	a)
CA13509PHQ96	1.1000 % CANHOU 1.1 03/15/31	90	0	0	90 CAD	83.39%	48'722.94	0.00	a)
CA13509PHS52	1.4000 % CANHOU 1.4 03/15/31	50	0	0	50 CAD	85.22%	27'663.62	0.00	a)
CA13509PHT36	1.2500 % CANHOU 1 1/4 06/15/26	100	80	0	180 CAD	93.67%	109'464.63	0.01	a)
CA13509PHU09	1.9000 % CANHOU 1.9 03/15/31 100	40	40	0	80 CAD	88.28%	45'849.50	0.00	a)
CA13509PHW64	1.6000 % CANHOU 1.6 12/15/31 101	80	0	0	80 CAD	85.09%	44'192.72	0.00	a)
CA13509PHX48	1.1000 % CANHOU 1.1 12/15/26	80	0	0	80 CAD	92.29%	47'932.67	0.00	a)
CA13509PHZ95	2.1500 % CANHOU 2.15 12/15/31 104	35	50	0	85 CAD	88.76%	48'979.41	0.01	a)
CA13509PIA27	1.5500 % CANHOU 1.55 12/15/26	40	50	0	90 CAD	93.46%	54'608.45	0.01	a)
CA13509PIB00	2.4500 % CANHOU 2.45 12/15/31	50	0	0	50 CAD	90.80%	29'472.64	0.00	a)
CA13509PIC82	3.5500 % CANHOU 3.55 09/15/32	155	60	0	215 CAD	97.80%	136'508.46	0.01	a)
CA13509PIE49	3.8000 % CANHOU 3.8 06/15/27	50	0	0	50 CAD	99.49%	32'295.71	0.00	a)
CA13509PIF14	3.6000 % CANHOU 3.6 12/15/27	180	0	0	180 CAD	98.96%	115'642.86	0.01	a)
CA13509PIK09	3.6500 % CANHOU 3.65 06/15/33	0	160	0	160 CAD	98.25%	102'057.20	0.01	a)
CA13509PIL81	3.1000 % CANHOU 3.1 06/15/28	0	130	0	130 CAD	97.09%	81'936.56	0.01	a)
CA13509PIN48	3.9500 % CANHOU 3.95 06/15/28	0	80	0	80 CAD	100.41%	52'150.43	0.01	a)
CA13509PIJ95	4.1500 % CANHOU 4.15 06/15/33	0	80	0	80 CAD	102.11%	53'030.75	0.01	a)
CA13509PIQ78	4.2500 % CANHOU 4 1/4 12/15/28	0	200	0	200 CAD	101.88%	132'286.03	0.01	a)
CA13509PJS35	4.2500 % CANHOU 4 1/4 03/15/34	0	150	0	150 CAD	102.98%	100'281.81	0.01	a)
CA1360695D97	3.2900 % CM 3.29 01/15/24	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607GRU09	1.1000 % CM 1.1 01/19/26	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607H5C22	5.0500 % CM 5.05 10/07/27	70	0	70	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607HBC57	2.0100 % CM 2.01 07/21/30	30	0	30	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607HC349	2.2500 % CM 2 1/4 01/07/27	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607HK276	2.7500 % CM 2 3/4 03/07/25	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607HRJ37	1.9600 % CM 1.96 04/21/31	30	0	30	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607HVV19	1.7000 % CM 1.7 07/15/26	0	60	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA13607LGL14	5.3300 % CM 5.33 01/20/33	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA136375CS98	3.0000 % CNRCN 3 02/08/29	50	0	0	50 CAD	93.98%	30'507.14	0.00	a)
CA136375DG42	4.7000 % CNRCN 4.7 05/10/53	0	80	0	80 CAD	98.88%	51'352.16	0.01	a)
CA13645RBC75	2.5400 % CP 2.54 02/28/28	50	0	0	50 CAD	93.17%	30'242.92	0.00	a)
CA136765BU77	5.1460 % CWBCN 5.146 09/02/27 DPNT	0	60	0	60 CAD	100.67%	39'214.48	0.00	a)
CA15135UAT66	3.5000 % CVECN 3 1/2 02/07/28	40	0	0	40 CAD	95.80%	24'878.08	0.00	a)
CA17039AAV85	2.4560 % CHPUCN 2.456 11/30/26 Q	50	0	0	50 CAD	94.20%	30'577.91	0.00	a)
CA17039AAW68	6.0030 % CHPUCN 6.003 06/24/32 R	50	0	0	50 CAD	105.69%	34'306.62	0.00	a)
CA227107AT67	5.2440 % CRRUCN 5.244 09/28/29	0	50	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA23384NB559	1.6500 % MBGGR 1.65 09/22/25 MTN	50	0	0	50 CAD	95.30%	30'934.97	0.00	a)
CA233852AH58	5.7700 % DTRGR 5.77 09/25/28	0	40	0	40 CAD	103.75%	26'941.25	0.00	a)
CA233852AJ15	5.8100 % DTRGR 5.81 09/25/26	0	40	0	40 CAD	102.16%	26'529.40	0.00	a)
CA254687FU53	3.0570 % DIS 3.057 03/30/27 MPLE	50	0	0	50 CAD	95.95%	31'145.31	0.00	a)
CA25675TAP27	5.1650 % DOLCN 5.165 04/26/30	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA29250ZAX65	3.5200 % ENBPIP 3.52 02/22/29 MTN	50	0	0	50 CAD	94.85%	30'788.58	0.00	a)
CA29250ZBA53	4.2000 % ENBPIP 4.2 05/12/51 MTN	50	0	0	50 CAD	82.73%	26'854.39	0.00	a)
CA29251ZBK27	3.2000 % ENBCN 3.2 06/08/27 MTN	50	0	0	50 CAD	95.53%	31'008.33	0.00	a)
CA29251ZBU09	3.1000 % ENBCN 3.1 09/21/33 MTN	0	50	0	50 CAD	85.34%	27'700.30	0.00	a)
CA29251ZBV81	4.1000 % ENBCN 4.1 09/21/51 MTN	40	0	0	40 CAD	80.50%	20'904.68	0.00	a)
CA29251ZBW64	6.1000 % ENBCN 6.1 11/09/32	70	0	0	70 CAD	107.10%	48'672.76	0.00	a)
CA29260ZAD83	3.6500 % ENBGAS 3.65 04/01/50 MTN	80	0	0	80 CAD	83.38%	43'303.57	0.00	a)
CA29260ZAJ53	5.7000 % ENBGAS 5.7 10/06/33 MTN	0	60	0	60 CAD	108.10%	42'106.70	0.00	a)
CA29290ZAL46	4.5000 % ENBGAS 4 1/2 11/23/43 MTN	40	0	0	40 CAD	96.21%	24'984.81	0.00	a)
CA29410ZAV72	4.7250 % EPCOR 4.725 09/02/52 MTN	50	0	0	50 CAD	100.80%	32'720.61	0.00	a)
CA31430WCG74	2.4170 % CCDJ 2.417 10/04/24	50	0	0	50 CAD	98.45%	31'958.44	0.00	a)
CA31430WDW16	2.8560 % CCDJ 2.856 05/26/30	50	0	0	50 CAD	97.11%	31'520.55	0.00	a)
CA31430WPB41	4.4070 % CCDJ 4.407 05/19/27	0	60	0	60 CAD	99.09%	38'596.70	0.00	a)
CA32117DAD62	2.8500 % FNFACA 2.85 06/01/32	0	50	0	50 CAD	90.61%	29'411.93	0.00	a)
CA34527ACJ75	2.9610 % F 2.961 09/16/26	0	50	0	50 CAD	94.48%	30'668.15	0.00	a)
CA34527ACP36	6.3820 % F 6.382 11/10/28	0	50	0	50 CAD	104.03%	33'767.13	0.00	a)
CA349553AP21	2.1800 % FTSCN 2.18 05/15/28	50	0	0	50 CAD	91.64%	29'745.30	0.00	a)
CA34959ZAM47	4.6700 % FTSCN 4.67 11/28/52	50	0	0	50 CAD	99.63%	32'338.55	0.00	a)
CA35085ZBQ87	3.6500 % ETRHWY 3.65 09/08/44 MTN	80	0	0	80 CAD	85.68%	44'497.59	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA35085ZBV72	2.8400 % ETRHWY 2.84 03/07/50 MTN	40	0	0	40 CAD	72.26%	18'763.86	0.00	a)
CA35085ZBW55	1.8000 % ETRHWY 1.8 05/22/25	50	0	0	50 CAD	96.52%	31'329.36	0.00	a)
CA37045YAH77	1.7000 % GM 1.7 07/09/25	50	0	0	50 CAD	95.54%	31'011.90	0.00	a)
CA37045YAK07	5.2000 % GM 5.2 02/09/28	0	70	0	70 CAD	100.88%	45'842.48	0.00	a)
CA38141GZC19	2.5990 % GS 2.599 11/30/27	100	0	0	100 CAD	93.88%	60'949.37	0.01	a)
CA39138CAJ59	2.9810 % GWOCN 2.981 07/08/50	50	50	50	50 CAD	73.86%	23'974.51	0.00	a)
CA39138CAK23	2.3790 % GWOCN 2.379 05/14/30	50	60	50	60 CAD	89.38%	34'815.21	0.00	a)
CA39191ZAA71	7.0500 % GTAAIR 7.05 06/12/30 MTN	0	60	0	60 CAD	112.99%	44'010.69	0.00	a)
CA39191ZAX74	5.3000 % GTAAIR 5.3 02/25/41 MTN	50	0	0	50 CAD	107.53%	34'904.54	0.00	a)
CA40427HTM56	1.7820 % RY 1.782 05/20/26 DPNT	50	0	0	50 CAD	94.11%	30'548.04	0.00	a)
CA40427HTP87	3.4030 % RY 3.403 03/24/25 DPNT	0	40	0	40 CAD	98.35%	25'539.49	0.00	a)
CA438121AS48	3.4440 % HNDA 3.444 05/23/25	0	50	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA438121BA21	1.7110 % HNDA 1.711 09/28/26	60	0	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA44810ZAP59	5.3600 % HYDONE 5.36 05/20/36 MTN	50	0	0	50 CAD	105.75%	34'325.45	0.00	a)
CA44810ZCC29	2.1600 % HYDONE 2.16 02/28/30 MTN	60	0	0	60 CAD	88.79%	34'584.22	0.00	a)
CA44810ZCD02	2.7100 % HYDONE 2.71 02/28/50 MTN	50	0	0	50 CAD	70.95%	23'030.24	0.00	a)
CA44810ZCJ71	4.9100 % HYDONE 4.91 01/27/28 MTN	70	0	0	70 CAD	101.97%	46'340.10	0.00	a)
CA44810ZCM01	4.4600 % HYDONE 4.46 01/27/53 MTN	50	0	0	50 CAD	96.84%	31'434.86	0.00	a)
CA4488148V86	4.0000 % QHEL 4 02/15/55	100	70	0	170 CAD	95.48%	105'370.94	0.01	a)
CA448814HZ92	5.0000 % QHEL 5 02/15/45 JM	120	0	0	120 CAD	108.17%	84'267.92	0.01	a)
CA448814JA24	5.0000 % QHEL 5 02/15/50 JN	95	0	0	95 CAD	110.93%	68'414.94	0.01	a)
CA448814JC89	2.1000 % QHEL 2.1 02/15/60 JR	100	0	0	100 CAD	61.38%	39'847.59	0.00	a)
CA448814JD62	4.0000 % QHEL 4 02/15/63	50	0	0	50 CAD	96.06%	31'181.67	0.00	a)
CA44889ZCM64	6.5000 % QHEL 6 1/2 02/15/35 19	70	50	0	120 CAD	119.70%	93'254.23	0.01	a)
CA44889ZCN48	6.0000 % QHEL 6 02/15/40 MTN	0	60	0	60 CAD	118.66%	46'220.84	0.00	a)
CA44889ZFE12	2.0000 % QHEL 2 09/01/28	60	50	0	110 CAD	91.94%	65'658.90	0.01	a)
CA449586AC09	3.4400 % IGMCN 3.44 01/26/27	0	50	0	50 CAD	96.12%	31'202.12	0.00	a)
CA449586AK25	5.4260 % IGMCN 5.426 05/26/53	0	70	0	70 CAD	106.92%	48'588.69	0.00	a)
CA458182EC20	0.8750 % IADB 0 7/8 08/27/27	30	0	0	30 CAD	89.89%	17'506.93	0.00	a)
CA458182EE85	0.7500 % IADB 0 3/4 10/15/25	40	0	0	40 CAD	94.17%	24'455.31	0.00	a)
CA458182EL29	4.6000 % IADB 4.6 03/01/29	0	50	0	50 CAD	103.04%	33'446.42	0.00	a)
CA45823TAF36	2.1790 % IFCCN 2.179 05/18/28	50	0	0	50 CAD	91.66%	29'752.77	0.00	a)
CA45823TAN69	5.2760 % IFCCN 5.276 09/14/54	0	40	0	40 CAD	107.81%	27'996.86	0.00	a)
CA45833VAF63	5.7600 % IPLCN 5.76 02/17/28	0	60	0	60 CAD	102.55%	39'946.79	0.00	a)
CA45833VAG47	6.3800 % IPLCN 6.38 02/17/33	0	70	0	70 CAD	104.75%	47'603.91	0.00	a)
CA459058HS51	1.9000 % IBRD 1.9 01/16/25 GDIF	50	0	0	50 CAD	97.56%	31'669.22	0.00	a)
CA459058KF93	1.8000 % IBRD 1.8 01/19/27	50	0	0	50 CAD	93.72%	30'420.15	0.00	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	60	0	0	60 CAD	99.09%	38'599.04	0.00	a)
CA45950KCY43	1.8500 % IFC 1.85 01/28/27 GMTN	40	0	0	40 CAD	93.83%	24'364.95	0.00	a)
CA47788ZAL54	2.3100 % DE 2.31 06/20/25	50	0	0	50 CAD	96.82%	31'428.69	0.00	a)
CA47788ZAM38	2.8100 % DE 2.81 01/19/29	50	0	0	50 CAD	93.06%	30'208.83	0.00	a)
CA48124BAG01	1.8960 % JPM 1.896 03/05/28 MPLE	0	100	0	100 CAD	92.21%	59'865.84	0.01	a)
CA539481AN18	2.2840 % LCN 2.284 05/07/30	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA539481AP65	5.0080 % LCN 5.008 09/13/32	0	50	0	50 CAD	101.47%	32'938.09	0.00	a)
CA539481AQ49	5.3360 % LCN 5.336 09/13/52	0	90	50	40 CAD	104.41%	27'113.68	0.00	a)
CA563469FL45	4.6000 % MP 4.6 03/05/38	50	0	0	50 CAD	101.82%	33'051.38	0.00	a)
CA563469TM71	4.1000 % MP 4.1 03/05/41	40	0	0	40 CAD	95.09%	24'693.96	0.00	a)
CA563469UE37	2.4500 % MP 2.45 06/02/25	90	0	0	90 CAD	97.42%	56'922.80	0.01	a)
CA563469UF02	2.8500 % MP 2.85 09/05/46	80	0	0	80 CAD	76.67%	39'820.19	0.00	a)
CA563469UJ24	2.5500 % MP 2.55 06/02/26	0	20	0	20 CAD	96.40%	12'516.03	0.00	a)
CA563469UR40	3.0000 % MP 3 06/02/28	70	0	0	70 CAD	96.28%	43'751.59	0.00	a)
CA563469US23	3.2000 % MP 3.2 03/05/50	80	0	0	80 CAD	80.80%	41'964.65	0.00	a)
CA563469UV51	2.0500 % MP 2.05 06/02/30	50	0	0	50 CAD	89.22%	28'962.36	0.00	a)
CA563469UW35	2.0500 % MP 2.05 09/05/52	30	0	0	30 CAD	62.00%	12'074.25	0.00	a)
CA563469UX18	2.0500 % MP 2.05 06/02/31	40	0	0	40 CAD	87.43%	22'704.28	0.00	a)
CA563469UZ65	3.8000 % MP 3.8 09/05/53	0	60	0	60 CAD	90.12%	35'102.29	0.00	a)
CA563469VA06	3.9000 % MP 3.9 12/02/32	0	60	0	60 CAD	98.06%	38'197.83	0.00	a)
CA565018DF20	1.3370 % MFCCN 1.337 02/26/26 DPNT	0	50	0	50 CAD	93.84%	30'462.02	0.00	a)
CA565018DH85	2.8640 % MFCCN 2.864 02/16/27 DPNT	60	0	0	60 CAD	95.22%	37'089.25	0.00	a)
CA56501RAJ55	2.8180 % MFCCN 2.818 05/13/35	0	80	0	80 CAD	88.84%	46'137.74	0.00	a)
CA58769CAB87	5.1200 % MBGGR 5.12 06/27/28 MTN	0	50	0	50 CAD	102.13%	33'152.66	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA59162NAL34	4.6570 % MRUCN 4.657 02/07/33	60	0	0	60 CAD	99.40%	38'719.01	0.00	a)
CA592179KA25	1.9500 % MET 1.95 03/20/28 MPLE	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA614852NZ03	3.5000 % MNTRL 3 1/2 12/01/38	40	40	0	40 CAD	88.56%	22'996.42	0.00	a)
CA614852PQ85	3.1500 % MNTRL 3.15 09/01/28	50	0	0	50 CAD	96.17%	31'217.05	0.00	a)
CA614853EK18	1.7500 % MNTRL 1 3/4 09/01/30	50	0	0	50 CAD	86.40%	28'044.38	0.00	a)
CA614853EL90	2.4000 % MNTRL 2.4 12/01/41	50	0	0	50 CAD	73.12%	23'734.63	0.00	a)
CA61747YEE10	1.7790 % MS 1.779 08/04/27 MPLE	0	100	0	100 CAD	92.78%	60'233.29	0.01	a)
CA626209JC59	4.9500 % BCMFA 4.95 12/01/27	0	50	0	50 CAD	103.22%	33'503.88	0.00	a)
CA626209JR29	2.5000 % BCMFA 2 1/2 04/19/26	50	0	0	50 CAD	96.33%	31'268.66	0.00	a)
CA62620DAP65	3.3000 % BCMFA 3.3 04/08/32	50	0	0	50 CAD	94.29%	30'608.10	0.00	a)
CA62895ZAP59	3.2930 % NAVCAN 3.293 03/30/48	0	80	80	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA63306AGD24	2.5450 % NACN 2.545 07/12/24	50	0	0	50 CAD	99.07%	32'159.37	0.00	a)
CA63306AGE07	2.5800 % NACN 2.58 02/03/25	50	0	0	50 CAD	97.76%	31'731.55	0.00	a)
CA63306AHB58	2.2370 % NACN 2.237 11/04/26	50	0	0	50 CAD	93.91%	30'483.45	0.00	a)
CA63306AHP45	5.2190 % NACN 5.219 06/14/28	0	50	0	50 CAD	101.93%	33'085.14	0.00	a)
CA642866FZ57	4.5500 % NBRNS 4.55 03/26/37	40	0	0	40 CAD	101.72%	26'413.84	0.00	a)
CA642866GG67	3.8000 % NBRNS 3.8 08/14/45	40	0	0	40 CAD	90.63%	23'534.22	0.00	a)
CA642866GN19	3.1000 % NBRNS 3.1 08/14/28	60	0	0	60 CAD	96.44%	37'567.19	0.00	a)
CA642866GQ40	3.0500 % NBRNS 3.05 08/14/50	40	0	0	40 CAD	78.85%	20'474.91	0.00	a)
CA642866GR23	1.8000 % NBRNS 1.8 08/14/25	50	0	0	50 CAD	96.21%	31'231.33	0.00	a)
CA642866HA88	3.9500 % NBRNS 3.95 08/14/32	0	50	0	50 CAD	98.52%	31'978.57	0.00	a)
CA642869AA90	4.8000 % NBRNS 4.8 06/03/41	0	50	0	50 CAD	103.98%	33'753.50	0.00	a)
CA642869AE13	3.5500 % NBRNS 3.55 06/03/43	40	0	0	40 CAD	88.22%	22'908.65	0.00	a)
CA64953BBE70	5.2500 % NYLIFE 5 1/4 06/30/26	0	50	0	50 CAD	101.20%	32'850.45	0.00	a)
CA651333FV32	3.0000 % NF 3 06/02/26 6Z	50	0	0	50 CAD	97.22%	31'556.59	0.00	a)
CA651333FZ46	2.8500 % NF 2.85 06/02/28	50	0	0	50 CAD	95.33%	30'943.09	0.00	a)
CA651333GD25	2.6500 % NF 2.65 10/17/50	60	60	0	120 CAD	69.72%	54'317.47	0.01	a)
CA651333GE08	1.7500 % NF 1 3/4 06/02/30	50	0	0	50 CAD	86.92%	28'215.45	0.00	a)
CA651333GG55	2.0500 % NF 2.05 06/02/31	0	50	0	50 CAD	86.66%	28'128.78	0.00	a)
CA651333GH39	3.1500 % NF 3.15 12/02/52	40	0	0	40 CAD	76.98%	19'990.34	0.00	a)
CA663307AP16	2.0000 % NWRWPT 2 12/01/26 M	50	0	0	50 CAD	93.38%	30'310.76	0.00	a)
CA663307AQ98	2.8000 % NWRWPT 2.8 06/01/31 N	50	0	0	50 CAD	88.48%	28'721.18	0.00	a)
CA663307AR71	3.7500 % NWRWPT 3 3/4 06/01/51 O	0	70	0	70 CAD	82.83%	37'639.77	0.00	a)
CA669827BZ37	4.4000 % NS 4.4 06/01/42	35	0	0	35 CAD	99.06%	22'507.47	0.00	a)
CA669827FW28	4.7000 % NS 4.7 06/01/41	30	0	0	30 CAD	102.71%	20'003.00	0.00	a)
CA669827GB71	3.1500 % NS 3.15 12/01/51	30	0	0	30 CAD	80.32%	15'642.28	0.00	a)
CA669827GC54	2.0000 % NS 2 09/01/30	50	0	0	50 CAD	88.55%	28'744.23	0.00	a)
CA669827GD38	1.1000 % NS 1.1 06/01/28	0	50	0	50 CAD	88.95%	28'872.44	0.00	a)
CA669827GE11	2.4000 % NS 2.4 12/01/31	0	50	0	50 CAD	88.79%	28'822.78	0.00	a)
CA669827GH42	4.7500 % NS 4 3/4 12/01/54	0	40	0	40 CAD	106.40%	27'629.41	0.00	a)
CA68214WAR93	3.3310 % OMERS 3.331 06/05/25 10	50	0	0	50 CAD	98.17%	31'865.61	0.00	a)
CA68214WAV06	4.5390 % OMERS 4.539 04/09/29	0	50	0	50 CAD	99.67%	32'353.16	0.00	a)
CA68321ZAG69	3.2150 % ONTPOW 3.215 04/08/30 MTN	50	0	0	50 CAD	93.34%	30'299.40	0.00	a)
CA68321ZAJ09	2.9470 % ONTPOW 2.947 02/21/51	0	50	0	50 CAD	71.14%	23'093.54	0.00	a)
CA683234B984	4.6500 % ONT 4.65 06/02/41	150	100	0	250 CAD	103.36%	167'754.72	0.02	a)
CA683234KG29	7.6000 % ONT 7.6 06/02/27 KJ	40	70	0	110 CAD	110.76%	79'093.04	0.01	a)
CA683234SL32	5.8500 % ONT 5.85 03/08/33	100	0	0	100 CAD	112.42%	72'983.69	0.01	a)
CA683234VR64	5.6000 % ONT 5.6 06/02/35	120	0	0	120 CAD	112.19%	87'397.35	0.01	a)
CA683234YD42	4.7000 % ONT 4.7 06/02/37	100	50	0	150 CAD	104.18%	101'447.46	0.01	a)
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	170	0	0	170 CAD	102.94%	113'604.16	0.01	a)
CA68323AAY07	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/43	190	0	0	190 CAD	88.75%	109'475.99	0.01	a)
CA68323ACC68	3.4500 % ONT 3.45 06/02/45	200	130	0	330 CAD	87.38%	187'201.03	0.02	a)
CA68323ACG72	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/24	110	0	110	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA68323ACX06	2.6000 % ONT 2.6 06/02/25	190	0	0	190 CAD	97.62%	120'410.89	0.01	a)
CA68323ACY88	2.9000 % ONT 2.9 12/02/46	210	60	0	270 CAD	79.11%	138'659.60	0.01	a)
CA68323ADM32	2.4000 % ONT 2.4 06/02/26	150	0	0	150 CAD	96.11%	93'589.80	0.01	a)
CA68323ADZ45	2.8000 % ONT 2.8 06/02/48	170	70	0	240 CAD	77.09%	120'113.42	0.01	a)
CA68323AEE07	2.6000 % ONT 2.6 06/02/27	120	50	0	170 CAD	95.71%	105'633.60	0.01	a)
CA68323AER10	2.6500 % ONT 2.65 02/05/25	40	0	0	40 CAD	98.17%	25'494.04	0.00	a)
CA68333ZAA53	2.9000 % ONT 2.9 06/02/49	190	0	0	190 CAD	78.16%	96'409.63	0.01	a)
CA68333ZAC10	2.9000 % ONT 2.9 06/02/28	170	0	0	170 CAD	96.01%	105'962.49	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA68333ZAE75	2.7000 % ONT 2.7 06/02/29	170	50	0	220 CAD	94.17%	134'491.38	0.01	a)
CA68333ZAF41	2.3000 % ONT 2.3 09/08/24	90	0	0	90 CAD	98.73%	57'684.12	0.01	a)
CA68333ZAG24	2.6500 % ONT 2.65 12/02/50	170	60	0	230 CAD	74.10%	110'647.10	0.01	a)
CA68333ZAH07	2.0500 % ONT 2.05 06/02/30	150	80	0	230 CAD	89.41%	133'510.56	0.01	a)
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	90	0	0	90 CAD	94.01%	54'926.88	0.01	a)
CA68333ZAK36	1.7500 % ONT 1 3/4 09/08/25	130	50	0	180 CAD	96.05%	112'235.31	0.01	a)
CA68333ZAL19	1.9000 % ONT 1.9 12/02/51	190	50	0	240 CAD	62.01%	96'617.37	0.01	a)
CA68333ZAN74	1.3500 % ONT 1.35 12/02/30	150	0	0	150 CAD	84.41%	82'201.11	0.01	a)
CA68333ZAP23	2.1500 % ONT 2.15 06/02/31	90	120	0	210 CAD	88.29%	120'363.11	0.01	a)
CA68333ZAQ06	1.3500 % ONT 1.35 09/08/26	0	40	0	40 CAD	93.40%	24'253.02	0.00	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	80	0	0	80 CAD	87.92%	45'664.08	0.00	a)
CA68333ZAS61	2.5500 % ONT 2.55 12/02/52	130	0	0	130 CAD	72.08%	60'828.94	0.01	a)
CA68333ZAT45	2.2500 % ONT 2 1/4 12/02/31	110	80	0	190 CAD	88.05%	108'603.92	0.01	a)
CA68333ZAU18	3.7500 % ONT 3 3/4 06/02/32	80	120	0	200 CAD	97.57%	126'679.49	0.01	a)
CA68333ZAV90	3.7500 % ONT 3 3/4 12/02/53	110	100	0	210 CAD	91.85%	125'222.02	0.01	a)
CA68333ZAW73	3.6000 % ONT 3.6 03/08/28	60	50	0	110 CAD	98.70%	70'484.97	0.01	a)
CA68333ZAY30	3.6500 % ONT 3.65 06/02/33	0	210	0	210 CAD	96.21%	131'166.15	0.01	a)
CA68333ZAZ05	3.4000 % ONT 3.4 09/08/28	0	80	0	80 CAD	97.79%	50'788.65	0.01	a)
CA68333ZBA45	4.1500 % ONT 4.15 12/02/54	0	140	0	140 CAD	98.73%	89'735.40	0.01	a)
CA689551FH76	4.1000 % OTTAWA 4.1 12/06/52	50	0	0	50 CAD	93.36%	30'304.27	0.00	a)
CA69363TAQ54	1.5000 % P5PCAP 1 1/2 03/15/28 14	150	0	0	150 CAD	90.83%	88'449.07	0.01	a)
CA70632ZAE12	3.5400 % PPLCN 3.54 02/03/25 MTN	40	0	0	40 CAD	98.57%	25'595.58	0.00	a)
CA70632ZAL54	4.7500 % PPLCN 4 3/4 03/26/48 11	0	60	0	60 CAD	88.62%	34'519.17	0.00	a)
CA70632ZAS08	3.5300 % PPLCN 3.53 12/10/31	50	0	0	50 CAD	90.42%	29'348.96	0.00	a)
CA70632ZAT80	4.4900 % PPLCN 4.49 12/10/51	30	0	0	30 CAD	84.22%	16'401.85	0.00	a)
CA74340XCD18	5.2500 % PLD 5 1/4 01/15/31	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA748148RL96	5.7500 % Q 5 3/4 12/01/36	80	0	0	80 CAD	114.35%	59'388.81	0.01	a)
CA748148RY18	2.2500 % Q 2 1/4 02/22/24 QV	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZDK62	5.0000 % Q 5 12/01/38	40	50	0	90 CAD	107.31%	62'701.38	0.01	a)
CA74814ZEF68	5.0000 % Q 5 12/01/41	130	60	0	190 CAD	107.48%	132'576.81	0.01	a)
CA74814ZEK53	4.2500 % Q 4 1/4 12/01/43	90	50	0	140 CAD	98.31%	89'353.67	0.01	a)
CA74814ZER07	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/45	170	0	0	170 CAD	87.84%	96'944.57	0.01	a)
CA74814ZES89	3.7500 % Q 3 3/4 09/01/24	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA74814ZEV19	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/25	150	0	0	150 CAD	97.53%	94'976.51	0.01	a)
CA74814ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	120	100	0	220 CAD	87.21%	124'563.60	0.01	a)
CA74814ZEX74	2.5000 % Q 2 1/2 09/01/26	110	50	0	160 CAD	96.14%	99'866.52	0.01	a)
CA74814ZFB46	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/27	50	50	0	100 CAD	96.08%	62'373.73	0.01	a)
CA74814ZFD02	2.7500 % Q 2 3/4 09/01/28	120	0	0	120 CAD	95.16%	74'132.53	0.01	a)
CA74814ZFE84	3.1000 % Q 3.1 12/01/51	220	50	0	270 CAD	80.99%	141'954.97	0.01	a)
CA74814ZFF59	2.3000 % Q 2.3 09/01/29	90	70	0	160 CAD	91.97%	95'532.94	0.01	a)
CA74814ZFG33	1.9000 % Q 1.9 09/01/30	180	0	0	180 CAD	88.17%	103'029.32	0.01	a)
CA74814ZFH16	1.5000 % Q 1 1/2 09/01/31	130	120	0	250 CAD	83.74%	135'912.81	0.01	a)
CA74814ZFL28	2.8500 % Q 2.85 12/01/53	130	60	0	190 CAD	76.64%	94'529.79	0.01	a)
CA74814ZFN83	3.2500 % Q 3 1/4 09/01/32	180	50	0	230 CAD	93.90%	140'211.92	0.01	a)
CA74814ZFQ15	4.4000 % Q 4.4 12/01/55	60	110	0	170 CAD	102.92%	113'590.92	0.01	a)
CA74814ZFS70	3.6000 % Q 3.6 09/01/33	0	220	0	220 CAD	95.70%	136'685.17	0.01	a)
CA766910BG73	1.9740 % REIUCN 1.974 06/15/26 AD	50	0	0	50 CAD	93.38%	30'312.71	0.00	a)
CA766910BL68	5.9620 % REIUCN 5.962 10/01/29	0	60	0	60 CAD	103.14%	40'175.83	0.00	a)
CA775109BJ98	3.2500 % RCICN 3 1/4 05/01/29	50	0	0	50 CAD	92.91%	30'159.49	0.00	a)
CA775109BK61	3.6500 % RCICN 3.65 03/31/27	60	0	0	60 CAD	96.79%	37'703.13	0.00	a)
CA775109BV27	4.2500 % RCICN 4 1/4 04/15/32	0	80	0	80 CAD	94.79%	49'229.00	0.01	a)
CA775109BX82	5.2500 % RCICN 5 1/4 04/15/52	50	0	0	50 CAD	97.70%	31'713.37	0.00	a)
CA775109CV18	5.7000 % RCICN 5.7 09/21/28	0	50	0	50 CAD	103.62%	33'633.72	0.00	a)
CA780086NK64	2.3330 % RY 2.333 12/05/23 DPNT	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA780086RF34	2.6090 % RY 2.609 11/01/24	50	0	0	50 CAD	98.38%	31'935.72	0.00	a)
CA780086RQ98	2.3280 % RY 2.328 01/28/27	0	90	0	90 CAD	93.76%	54'782.56	0.01	a)
CA780086SA38	2.0880 % RY 2.088 06/30/30	50	0	0	50 CAD	96.04%	31'173.88	0.00	a)
CA780086TY05	1.8330 % RY 1.833 07/31/28	50	0	0	50 CAD	89.97%	29'204.84	0.00	a)
CA780086UL64	2.9400 % RY 2.94 05/03/32	50	0	0	50 CAD	93.99%	30'509.09	0.00	a)
CA780086UT90	3.3690 % RY 3.369 09/29/25	60	0	0	60 CAD	97.57%	38'007.35	0.00	a)
CA780086WK63	5.0100 % RY 5.01 02/01/33	0	60	0	60 CAD	99.90%	38'912.60	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA780086XL38	4.6320 % RY 4.632 05/01/28	0	80	0	80 CAD	99.98%	51'928.14	0.01	a)
CA780086ZH08	5.2280 % RY 5.228 06/24/30	0	70	0	70 CAD	102.93%	46'777.73	0.00	a)
CA80310ZAJ80	2.2970 % SAPCN 2.297 06/22/28	40	0	0	40 CAD	90.68%	23'546.95	0.00	a)
CA803854JT61	3.4000 % SCDA 3.4 02/03/42	50	0	0	50 CAD	87.47%	28'393.01	0.00	a)
CA803854KA51	2.7500 % SCDA 2 3/4 12/02/46	80	0	0	80 CAD	76.33%	39'644.13	0.00	a)
CA803854KF49	3.0500 % SCDA 3.05 12/02/28	50	0	0	50 CAD	96.13%	31'205.37	0.00	a)
CA803854KH05	3.1000 % SCDA 3.1 06/02/50	70	0	0	70 CAD	80.60%	36'629.09	0.00	a)
CA803854KM99	0.8000 % SCDA 0.8 09/02/25	80	0	0	80 CAD	94.72%	49'195.24	0.01	a)
CA803854KP21	2.1500 % SCDA 2.15 06/02/31	40	0	0	40 CAD	88.17%	22'894.88	0.00	a)
CA803854KV98	4.2000 % SCDA 4.2 12/02/54	0	60	0	60 CAD	98.59%	38'404.67	0.00	a)
CA83740TAH01	2.6500 % SOUCOA 2.65 10/29/50	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA83740TAJ66	1.6000 % SOUCOA 1.6 07/03/30	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA86682ZAQ96	2.8000 % SLFCN 2.8 11/21/33	50	0	0	50 CAD	91.55%	29'716.74	0.00	a)
CA86682ZAR79	3.1500 % SLFCN 3.15 11/18/36	60	0	0	60 CAD	88.13%	34'328.69	0.00	a)
CA86721ZAQ24	5.0000 % SUCN 5 04/09/30 MTN	50	0	0	50 CAD	100.10%	32'494.04	0.00	a)
CA87971MAW34	4.8500 % TCN 4.85 04/05/44 CP	60	0	0	60 CAD	92.72%	36'117.38	0.00	a)
CA87971MAX17	3.7500 % TCN 3 3/4 01/17/25 CQ	50	0	0	50 CAD	98.85%	32'087.96	0.00	a)
CA87971MBJ14	3.3000 % TCN 3.3 05/02/29 CY	50	0	0	50 CAD	93.65%	30'397.75	0.00	a)
CA87971MBX08	5.2500 % TCN 5 1/4 11/15/32 CAG	0	80	0	80 CAD	101.78%	52'858.32	0.01	a)
CA87971MCD35	5.9500 % TCN 5.95 09/08/53 CAL	0	60	0	60 CAD	108.01%	42'072.03	0.00	a)
CA880789AS10	3.7190 % TERANE 3.719 02/23/29	60	0	0	60 CAD	92.16%	35'898.08	0.00	a)
CA89117F3M90	2.6670 % TD 2.667 09/09/25	60	50	0	110 CAD	96.64%	69'011.01	0.01	a)
CA89117F7G86	4.2100 % TD 4.21 06/01/27	0	60	0	60 CAD	98.61%	38'411.68	0.00	a)
CA89117FJ347	1.8960 % TD 1.896 09/11/28	40	0	0	40 CAD	90.07%	23'390.36	0.00	a)
CA89117FMA44	2.8500 % TD 2.85 03/08/24	60	0	0	60 CAD	99.98%	38'943.77	0.00	a)
CA89117FVY29	1.9430 % TD 1.943 03/13/25	50	0	0	50 CAD	96.98%	31'478.68	0.00	a)
CA89117FWS42	3.1050 % TD 3.105 04/22/30 MTN	40	50	0	90 CAD	97.63%	57'043.75	0.01	a)
CA89117FZ442	2.2600 % TD 2.26 01/07/27	60	0	0	60 CAD	93.68%	36'489.38	0.00	a)
CA89117GRJ80	4.6800 % TD 4.68 01/08/29	0	50	0	50 CAD	100.08%	32'484.95	0.00	a)
CA89117GTQ06	4.4770 % TD 4.477 01/18/28	0	70	0	70 CAD	99.41%	45'178.09	0.00	a)
CA89119ZAQ69	3.2700 % TORHYD 3.27 10/18/51	60	0	0	60 CAD	79.02%	30'780.91	0.00	a)
CA89119ZAT09	5.1300 % TORHYD 5.13 10/12/28	0	50	0	50 CAD	103.46%	33'582.76	0.00	a)
CA891288DM16	3.5000 % TRNT 3 1/2 06/02/36	0	60	0	60 CAD	91.57%	35'669.04	0.00	a)
CA891288DY53	2.8500 % TRNT 2.85 11/23/41	50	0	0	50 CAD	78.71%	25'549.81	0.00	a)
CA891288DZ29	2.2000 % TRNT 2.2 12/21/31	50	0	0	50 CAD	87.42%	28'375.48	0.00	a)
CA891288EB42	4.3000 % TRNT 4.3 06/01/52	0	40	0	40 CAD	96.54%	25'068.68	0.00	a)
CA892329BU66	5.2900 % TOYOTA 5.29 07/13/26	0	200	0	200 CAD	101.47%	131'749.78	0.01	a)
CA89353ZCC01	4.1800 % TRPCN 4.18 07/03/48 MTN	50	0	0	50 CAD	82.32%	26'720.98	0.00	a)
CA89353ZCD83	4.3400 % TRPCN 4.34 10/15/49 MTN	0	40	0	40 CAD	84.19%	21'862.91	0.00	a)
CA89353ZCF32	3.8000 % TRPCN 3.8 04/05/27	50	0	0	50 CAD	97.43%	31'625.08	0.00	a)
CA89353ZCK27	5.3300 % TRPCN 5.33 05/12/32	70	0	0	70 CAD	101.87%	46'294.66	0.00	a)
CA89353ZCN65	5.2770 % TRPCN 5.277 07/15/30 MTN	0	50	0	50 CAD	102.29%	33'202.97	0.00	a)
CA90664ZAX83	2.8800 % ENBGAS 2.88 11/22/27 MTN	50	0	0	50 CAD	94.76%	30'758.06	0.00	a)
CA918423BA19	2.0500 % VW 2.05 12/10/24	50	0	50	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA918423BD57	5.7500 % VW 5 3/4 09/21/26	0	70	0	70 CAD	101.93%	46'323.29	0.00	a)
CA92277LAI58	5.3980 % VTR 5.398 04/21/28	0	50	0	50 CAD	101.42%	32'919.59	0.00	a)
CA92343VFI52	2.3750 % VZ 2 3/8 03/22/28 MPLE	0	60	0	60 CAD	91.91%	35'801.87	0.00	a)
CA92343VGA67	4.0500 % VZ 4.05 03/22/51 MPLE	0	40	0	40 CAD	83.66%	21'724.76	0.00	a)
CA949746TC53	2.5680 % WFC 2.568 05/01/26 MPLE	80	0	80	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA98704CIRC24	2.1500 % YORKMU 2.15 06/22/31	50	0	0	50 CAD	87.90%	28'533.88	0.00	a)
CAC04575AG89	3.1270 % ATH 3.127 03/10/25 MTN	60	0	60	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CAC69798AW34	4.1500 % ONTTFT 4.15 11/01/29	0	50	0	50 CAD	100.30%	32'557.98	0.00	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE	50	0	0	50 CAD	89.38%	29'013.00	0.00	a)
CAU74078CQ41	2.1920 % NESNVX 2.192 01/26/29 MPLE	100	0	0	100 CAD	91.04%	59'105.62	0.01	a)
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	50	0	0	50 CAD	93.23%	30'264.02	0.00	a)
XS2033281176	1.7500 % EIB 1 3/4 07/30/24 REGS	40	0	40	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
XS2102297012	1.9000 % EIB 1.9 01/22/25 REGS	40	0	0	40 CAD	97.53%	25'326.29	0.00	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	0	40	0	40 CAD	89.39%	23'212.74	0.00	a)
XS2635647311	3.9000 % EIB 3.9 06/15/28 REGS	0	40	0	40 CAD	99.86%	25'931.87	0.00	a)
CAD							26'399'195.31	2.70	
CND100002GY0	4.4200 % SDBC 4.42 04/07/40 1007	0	1'000	0	1'000 CNY	123.82%	151'316.14	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND100008408	4.2900 % EXIMCH 4.29 04/07/25 1508	0	1'000	0	1'000 CNY	102.43%	125'179.19	0.01	a)
CND100008457	3.9700 % ADBCH 3.97 02/27/25 1505	1'000	0	0	1'000 CNY	102.07%	124'734.35	0.01	a)
CND1000086W4	4.2100 % SDBC 4.21 04/13/25 1510	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.40%	375'412.92	0.04	a)
CND100008S02	3.8700 % EXIMCH 3.87 09/14/25 1514	1'000	1'000	0	2'000 CNY	102.55%	250'654.13	0.03	a)
CND100008S93	3.7400 % SDBC 3.74 09/10/25 1518	3'000	1'000	0	4'000 CNY	102.41%	500'604.33	0.05	a)
CND100009CF3	3.3300 % ADBCH 3.33 01/06/26 1605	2'000	0	0	2'000 CNY	102.06%	249'451.59	0.03	a)
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	4'000	0	0	4'000 CNY	112.56%	550'255.61	0.06	a)
CND100009JW3	3.3700 % ADBCH 3.37 02/26/26 1608	2'000	0	0	2'000 CNY	102.30%	250'050.41	0.03	a)
CND100009JY9	3.9500 % ADBCH 3.95 02/26/36 1610	1'000	0	0	1'000 CNY	113.74%	139'004.75	0.01	a)
CND100009K58	3.3300 % EXIMCH 3.33 02/22/26 1603	3'000	0	0	3'000 CNY	102.17%	374'591.67	0.04	a)
CND100009R93	3.1800 % SDBC 3.18 04/05/26 1610	4'000	1'000	0	5'000 CNY	102.02%	623'378.44	0.06	a)
CND100009RF1	3.5200 % CGB 3.52 04/25/46 1608	3'000	0	0	3'000 CNY	115.51%	423'481.58	0.04	a)
CND100009SC6	3.5800 % ADBCH 3.58 04/22/26 1618	2'000	0	0	2'000 CNY	102.89%	251'492.49	0.03	a)
CND10000BLB2	3.2700 % CGB 3.27 08/22/46 1619	2'000	0	0	2'000 CNY	111.73%	273'084.46	0.03	a)
CND10000BTG4	3.1800 % EXIMCH 3.18 09/05/26 1610	2'000	0	0	2'000 CNY	102.27%	249'974.64	0.03	a)
CND10000BV90	3.0500 % SDBC 3.05 08/25/26 1613	3'000	1'000	0	4'000 CNY	101.99%	498'546.32	0.05	a)
CND10000G727	3.8500 % ADBCH 3.85 01/06/27 1705	2'000	1'000	0	3'000 CNY	104.47%	383'031.46	0.04	a)
CND10000G735	3.8300 % ADBCH 3.83 01/06/24 1704	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000G9Z8	3.7700 % CGB 3.77 02/20/47 1705	0	2'000	0	2'000 CNY	120.65%	294'884.19	0.03	a)
CND10000H1F6	4.1100 % EXIMCH 4.11 03/20/27 1703	1'000	1'000	0	2'000 CNY	105.46%	257'752.06	0.03	a)
CND10000H4F0	4.0400 % SDBC 4.04 04/10/27 1710	4'000	0	0	4'000 CNY	105.27%	514'614.43	0.05	a)
CND10000HS81	4.0500 % CGB 4.05 07/24/47 1715	3'000	0	2'000	1'000 CNY	125.84%	153'792.10	0.02	a)
CND10000HZF0	4.3000 % SDBC 4.3 08/21/24 1708	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10000J275	4.2400 % SDBC 4.24 08/24/27 1715	2'000	1'000	0	3'000 CNY	106.41%	390'122.05	0.04	a)
CND10000JH7	4.3900 % ADBCH 4.39 09/08/27 1715	3'000	0	0	3'000 CNY	107.04%	392'420.81	0.04	a)
CND10000JH82	4.2800 % CGB 4.28 10/23/47 1722	1'000	0	0	1'000 CNY	130.05%	158'927.34	0.02	a)
CND10000LSW6	4.9800 % ADBCH 4.98 01/12/25 1801	2'000	0	0	2'000 CNY	102.68%	250'962.10	0.03	a)
CND10000L7C4	4.8800 % SDBC 4.88 02/09/28 1805	3'000	1'000	0	4'000 CNY	109.70%	536'255.29	0.05	a)
CND10000LMZ8	4.2200 % CGB 4.22 03/19/48 1806	1'000	0	0	1'000 CNY	129.44%	158'190.42	0.02	a)
CND10000LNZ6	4.8900 % EXIMCH 4.89 03/26/28 1810	2'000	0	0	2'000 CNY	109.79%	268'345.18	0.03	a)
CND10000LPY4	4.7300 % SDBC 4.73 04/02/25 1806	2'000	0	0	2'000 CNY	102.94%	251'597.59	0.03	a)
CND100010GW7	4.6500 % ADBCH 4.65 05/11/28 1806	2'000	1'000	0	3'000 CNY	109.12%	400'057.69	0.04	a)
CND100010Z58	4.3700 % EXIMCH 4.37 06/19/23 1809	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100011220	4.0400 % SDBC 4.04 07/06/28 1810	4'000	1'000	0	5'000 CNY	107.10%	654'407.43	0.07	a)
CND10001Q6Q0	4.0800 % CGB 4.08 10/22/48 1824	1'000	0	0	1'000 CNY	127.56%	155'892.88	0.02	a)
CND10001QNZ3	4.1500 % SDBC 4.15 10/26/25 1814	1'000	1'000	0	2'000 CNY	103.28%	252'433.50	0.03	a)
CND10001QZV6	4.0000 % ADBCH 4 11/12/25 1811	1'000	1'000	0	2'000 CNY	103.03%	251'822.45	0.03	a)
CND10001WKZ7	3.4800 % SDBC 3.48 01/08/29 1905	3'000	1'000	0	4'000 CNY	105.20%	514'252.69	0.05	a)
CND10001X8C7	3.7500 % ADBCH 3 3/4 01/25/29 1901	2'000	1'000	0	3'000 CNY	106.27%	389'619.77	0.04	a)
CND10001YBB3	3.3000 % SDBC 3.3 02/01/24 1903	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10001ZC52	3.6800 % SDBC 3.68 02/26/26 1904	2'000	0	0	2'000 CNY	102.90%	251'516.93	0.03	a)
CND100029N10	3.8600 % EXIMCH 3.86 05/20/29 1910	3'000	1'000	0	4'000 CNY	107.05%	523'296.19	0.05	a)
CND100029N93	3.6500 % SDBC 3.65 05/21/29 1910	4'000	1'000	0	5'000 CNY	106.24%	649'170.75	0.07	a)
CND10002CGX0	4.0000 % CGB 4 06/24/69 1908	0	3'000	0	3'000 CNY	134.76%	494'057.57	0.05	a)
CND10002CZL5	3.4200 % SDBC 3.42 07/02/24 1908	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002D258	3.6300 % ADBCH 3.63 07/19/26 1908	2'000	1'000	0	3'000 CNY	103.18%	378'294.62	0.04	a)
CND10002D282	3.7400 % ADBCH 3.74 07/12/29 1906	3'000	1'000	0	4'000 CNY	106.63%	521'243.07	0.05	a)
CND10002F4V7	3.5000 % SDBC 3 1/2 08/13/26 1909	1'000	0	0	1'000 CNY	103.12%	126'017.55	0.01	a)
CND10002F519	3.2400 % ADBCH 3.24 08/14/24 1909	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002GGR3	3.4500 % SDBC 3.45 09/20/29 1915	4'000	2'000	0	6'000 CNY	105.53%	773'813.44	0.08	a)
CND10002KVW4	3.2300 % SDBC 3.23 01/10/25 2003	3'000	0	3'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10002KY56	3.4300 % SDBC 3.43 01/14/27 2004	1'000	1'000	0	2'000 CNY	103.34%	252'570.37	0.03	a)
CND10002LS67	3.2600 % EXIMCH 3.26 02/24/27 2007	2'000	0	0	2'000 CNY	102.88%	251'460.71	0.03	a)
CND10002M036	2.9300 % EXIMCH 2.93 03/02/25 2005	2'000	0	0	2'000 CNY	101.01%	246'877.86	0.03	a)
CND10002RWH8	3.0700 % SDBC 3.07 03/10/30 2005	4'000	0	0	4'000 CNY	103.61%	506'485.05	0.05	a)
CND10002TD09	3.2300 % EXIMCH 3.23 03/23/30 2010	3'000	1'000	0	4'000 CNY	104.43%	510'513.08	0.05	a)
CND100034271	2.9600 % ADBCH 2.96 04/17/30 2004	3'000	1'000	0	4'000 CNY	102.91%	503'072.96	0.05	a)
CND100034370	2.2500 % ADBCH 2 1/4 04/22/25 2005	2'000	1'000	0	3'000 CNY	100.25%	367'530.41	0.04	a)
CND100036VL4	3.7300 % CGB 3.73 05/25/70 INBK	2'000	1'000	0	3'000 CNY	129.03%	473'053.42	0.05	a)
CND100036VN0	2.8700 % ADBCH 2.87 05/14/27	2'000	0	0	2'000 CNY	101.81%	248'852.76	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND10003BX04	3.0900 % SDBC 3.09 06/18/30 2010	4'000	1'000	0	5'000 CNY	103.82%	634'395.62	0.06	a)
CND10003C5P8	2.8900 % SDBC 2.89 06/22/25 2008	2'000	0	0	2'000 CNY	101.01%	246'877.86	0.03	a)
CND10003DVK3	3.3900 % SDBC 3.39 07/10/27 2009	1'000	0	0	1'000 CNY	103.48%	126'467.28	0.01	a)
CND10003F5H9	3.3400 % SDBC 3.34 07/14/25 2012	2'000	2'000	0	4'000 CNY	101.66%	496'938.05	0.05	a)
CND10003HJY9	3.9000 % SDBC 3.9 08/03/40 2020	2'000	0	0	2'000 CNY	117.00%	285'972.67	0.03	a)
CND10003NG76	3.3400 % EXIMCH 3.34 09/04/23 2013	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10003QXS3	3.4500 % ADBCH 3.45 09/23/25 2008	2'000	0	0	2'000 CNY	102.00%	249'297.60	0.03	a)
CND10003RVZ0	3.7000 % SDBC 3.7 10/20/30 2015	4'000	1'000	0	5'000 CNY	107.36%	656'045.04	0.07	a)
CND10003S2M4	3.4300 % EXIMCH 3.43 10/23/25 2015	2'000	0	0	2'000 CNY	102.08%	249'490.69	0.03	a)
CND10003S346	3.7900 % ADBCH 3.79 10/26/30 2010	3'000	1'000	0	4'000 CNY	107.90%	527'441.54	0.05	a)
CND10003VYQ5	3.7400 % EXIMCH 3.74 11/16/30 2011	2'000	2'000	0	4'000 CNY	107.64%	526'185.22	0.05	a)
CND1000428Z1	2.9800 % SDBC 2.98 01/08/24 2102	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100042902	3.4000 % SDBC 3.4 01/08/28 2104	2'000	0	0	2'000 CNY	104.03%	254'259.31	0.03	a)
CND100043ZB2	3.4800 % ADBCH 3.48 02/04/28	2'000	0	0	2'000 CNY	104.25%	254'811.70	0.03	a)
CND1000446L3	3.6600 % SDBC 3.66 03/01/31 2105	4'000	1'000	0	5'000 CNY	107.53%	657'047.16	0.07	a)
CND100045707	3.3000 % SDBC 3.3 03/03/26 2103	3'000	2'000	0	5'000 CNY	102.25%	624'820.51	0.06	a)
CND100045715	3.1900 % ADBCH 3.19 03/03/24 2102	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	2'000	1'000	0	3'000 CNY	129.25%	473'849.00	0.05	a)
CND100045L04	3.3500 % ADBCH 3.35 03/24/26 2103	1'000	1'000	0	2'000 CNY	102.30%	250'047.97	0.03	a)
CND100045M59	3.7200 % CGB 3.72 04/12/51 INBK	2'000	0	0	2'000 CNY	122.33%	298'987.99	0.03	a)
CND100045PN3	3.1400 % EXIMCH 3.14 04/02/24 2103	2'000	0	0	2'000 CNY	100.13%	244'734.30	0.03	a)
CND100047PRO	3.2200 % EXIMCH 3.22 05/14/26 2105	2'000	1'000	0	3'000 CNY	102.20%	374'690.66	0.04	a)
CND100047SF9	3.5200 % ADBCH 3.52 05/24/31 2105	3'000	1'000	0	4'000 CNY	106.70%	521'609.70	0.05	a)
CND1000484F6	3.4100 % SDBC 3.41 06/07/31 2110	3'000	1'000	0	4'000 CNY	106.04%	518'383.37	0.05	a)
CND100049188	3.0000 % SDBC 3 06/17/24 2107	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004BNT2	3.3800 % EXIMCH 3.38 07/16/31 2110	3'000	0	0	3'000 CNY	105.92%	388'318.24	0.04	a)
CND10004DT64	2.7800 % ADBCH 2.78 07/21/24 2106	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004JK34	3.0900 % SDBC 3.09 08/09/28 2109	0	1'000	0	1'000 CNY	103.11%	126'012.66	0.01	a)
CND10004JSJ5	2.9900 % ADBCH 2.99 08/11/26 2108	2'000	0	0	2'000 CNY	101.82%	248'874.76	0.03	a)
CND10004KQZ3	3.1900 % ADBCH 3.19 08/12/28	1'000	0	0	1'000 CNY	103.46%	126'437.95	0.01	a)
CND10004M1L3	2.8300 % SDBC 2.83 09/10/26 2108	2'000	1'000	0	3'000 CNY	101.55%	372'307.58	0.04	a)
CND10004M1X8	3.1200 % SDBC 3.12 09/13/31 2115	4'000	2'000	1'000	5'000 CNY	104.23%	636'919.25	0.07	a)
CND10004NCM5	3.5300 % CGB 3.53 10/18/51 INBK	2'000	0	0	2'000 CNY	118.88%	290'557.97	0.03	a)
CND10004NXC2	3.3000 % ADBCH 3.3 11/05/31 2110	3'000	0	0	3'000 CNY	105.47%	386'697.74	0.04	a)
CND10004NXL3	3.4900 % SDBC 3.49 11/08/41 2120	1'000	2'000	0	3'000 CNY	112.68%	413'131.66	0.04	a)
CND10004NXW0	2.8900 % CGB 2.89 11/18/31 INBK	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004P6B0	2.7300 % SDBC 2.73 11/11/24 2118	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004R1S3	3.0000 % SDBC 3 01/17/32 2205	3'000	2'000	0	5'000 CNY	103.53%	632'623.59	0.06	a)
CND10004R6Q6	2.6100 % EXIMCH 2.61 01/27/27 2205	1'000	1'000	0	2'000 CNY	101.03%	246'929.18	0.03	a)
CND10004R999	2.7500 % CGB 2 3/4 02/17/32 INBK	2'000	0	2'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND10004SDM2	2.7400 % ADBCH 2.74 02/23/27 2202	2'000	0	0	2'000 CNY	101.47%	248'021.74	0.03	a)
CND10004SF89	2.6500 % SDBC 2.65 02/24/27 2203	2'000	1'000	0	3'000 CNY	101.28%	371'314.01	0.04	a)
CND10004SGM5	2.9100 % ADBCH 2.91 02/21/29	2'000	0	0	2'000 CNY	102.40%	250'289.94	0.03	a)
CND10004SKD6	2.9900 % SDBC 2.99 03/01/29 2204	1'000	1'000	0	2'000 CNY	102.78%	251'204.07	0.03	a)
CND10004SWF6	2.6100 % ADBCH 2.61 03/09/25 2203	1'000	0	0	1'000 CNY	100.68%	123'036.86	0.01	a)
CND10004T1Y9	3.1800 % EXIMCH 3.18 03/11/32 2210	3'000	1'000	0	4'000 CNY	104.76%	512'082.25	0.05	a)
CND10004T3K4	2.5900 % SDBC 2.59 03/17/25 2202	1'000	0	0	1'000 CNY	100.68%	123'041.75	0.01	a)
CND10004TCP5	3.3200 % CGB 3.32 04/15/52 INBK	2'000	0	0	2'000 CNY	115.15%	281'443.59	0.03	a)
CND10004THF5	2.9800 % SDBC 2.98 04/22/32 2210	4'000	0	0	4'000 CNY	103.44%	505'658.92	0.05	a)
CND10004TM71	2.7600 % CGB 2.76 05/15/32 INBK	1'000	0	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND100054BC8	3.0600 % ADBCH 3.06 06/06/32 2205	3'000	1'000	0	4'000 CNY	103.87%	507'756.03	0.05	a)
CND100054QC6	2.5700 % EXIMCH 2.57 06/10/25 2203	0	2'000	0	2'000 CNY	100.60%	245'895.29	0.03	a)
CND100058Q29	2.6900 % SDBC 2.69 06/16/27 2208	3'000	1'000	0	4'000 CNY	101.41%	495'735.50	0.05	a)
CND100058VQ7	2.8200 % EXIMCH 2.82 06/17/27 2215	3'000	0	0	3'000 CNY	101.68%	372'784.19	0.04	a)
CND10005CWX0	3.4000 % CGB 3.4 07/15/2072 INBK	3'000	0	0	3'000 CNY	120.98%	443'558.16	0.05	a)
CND10005G4Z4	2.9600 % SDBC 2.96 07/18/32 2215	3'000	1'000	0	4'000 CNY	103.42%	505'556.26	0.05	a)
CND10005H377	2.4600 % ADBCH 2.46 07/27/25 2206	1'000	0	0	1'000 CNY	100.44%	122'748.44	0.01	a)
CND10005JNG9	2.8300 % ADBCH 2.83 08/11/29	1'000	1'000	0	2'000 CNY	102.16%	249'698.45	0.03	a)
CND10005KVM8	2.9000 % EXIMCH 2.9 08/19/32 2211	3'000	1'000	0	4'000 CNY	102.87%	502'857.87	0.05	a)
CND10005LBD7	2.5000 % ADBCH 2 1/2 08/24/27 2207	1'000	2'000	0	3'000 CNY	100.68%	369'106.91	0.04	a)
CND10005LHT0	2.2200 % SDBC 2.22 08/25/25 2207	1'000	0	0	1'000 CNY	100.18%	122'425.81	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CND10005N450	2.7400 % EXIMCH 2.74 09/05/29 2207	0	1'000	0	1'000 CNY	101.76%	124'362.83	0.01	a)
CND10005R756	2.1200 % ADBCH 2.12 10/13/24	1'000	0	0	1'000 CNY	100.19%	122'435.59	0.01	a)
CND10005R9B1	3.1200 % CGB 3.12 10/25/52 INBK	1'000	1'000	0	2'000 CNY	111.27%	271'952.80	0.03	a)
CND10005RB00	2.9700 % ADBCH 2.97 10/14/32 2210	1'000	2'000	0	3'000 CNY	103.40%	379'101.20	0.04	a)
CND10005S515	2.7700 % SDBC 2.77 10/24/32 2220	3'000	2'000	0	5'000 CNY	102.02%	623'390.66	0.06	a)
CND10005TZQ1	2.8000 % CGB 2.8 11/15/32 INBK	0	1'000	0	1'000 CNY	103.21%	126'126.31	0.01	a)
CND10005X234	2.6000 % ADBCH 2.6 12/01/25 2212	1'000	0	0	1'000 CNY	100.75%	123'121.18	0.01	a)
CND10005X8M2	2.6400 % EXIMCH 2.64 12/05/25 2213	0	1'000	0	1'000 CNY	100.83%	123'225.06	0.01	a)
CND10005ZT22	2.5900 % SDBC 2.59 01/11/26 2302	0	3'000	0	3'000 CNY	100.83%	369'653.19	0.04	a)
CND10005ZV06	2.7300 % SDBC 2.73 01/11/28 2303	0	3'000	0	3'000 CNY	101.67%	372'747.53	0.04	a)
CND10005ZX46	2.8700 % SDBC 2.87 01/09/30	0	2'000	0	2'000 CNY	102.31%	250'074.86	0.03	a)
CND1000620N9	2.8700 % EXIMCH 2.87 02/06/28 2305	0	3'000	0	3'000 CNY	102.04%	374'111.39	0.04	a)
CND1000639M1	2.4600 % CGB 2.46 02/15/26 INBK	0	1'000	0	1'000 CNY	100.68%	123'044.19	0.01	a)
CND100063JL3	3.1000 % EXIMCH 3.1 02/13/33 2310	0	4'000	0	4'000 CNY	104.61%	511'373.43	0.05	a)
CND100063XD1	2.8800 % CGB 2.88 02/25/33 INBK	0	2'000	0	2'000 CNY	103.96%	254'105.32	0.03	a)
CND100064F16	3.1000 % ADBCH 3.1 02/27/33 2302	0	3'000	0	3'000 CNY	104.59%	383'471.41	0.04	a)
CND1000651J2	3.0200 % SDBC 3.02 03/06/33 2305	0	4'000	0	4'000 CNY	104.13%	509'002.57	0.05	a)
CND1000651K0	2.9000 % ADBCH 2.9 03/08/28 2303	0	2'000	0	2'000 CNY	102.20%	249'791.33	0.03	a)
CND1000652C5	2.3500 % CGB 2.35 03/15/25 INBK	0	1'000	1'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000652X1	2.7200 % ADBCH 2.72 03/16/26 2304	0	1'000	0	1'000 CNY	101.02%	123'449.93	0.01	a)
CND100067586	3.2700 % CGB 3.27 03/25/2073 INBK	0	2'000	0	2'000 CNY	118.42%	289'448.31	0.03	a)
CND100067KG2	3.0100 % ADBCH 3.01 03/16/30 2301	0	2'000	0	2'000 CNY	103.08%	251'956.88	0.03	a)
CND100068GV7	2.5800 % ADBCH 2.58 03/23/25 2302	0	1'000	0	1'000 CNY	100.63%	122'973.31	0.01	a)
CND100069PK9	3.1900 % CGB 3.19 04/15/53 INBK	0	2'000	0	2'000 CNY	114.54%	279'959.97	0.03	a)
CND10006BBX4	2.6400 % EXIMCH 2.64 04/14/26 2303	0	2'000	0	2'000 CNY	100.94%	246'706.76	0.03	a)
CND10006DQZ3	2.5500 % ADBCH 2.55 05/11/26 2305	0	2'000	0	2'000 CNY	100.77%	246'303.47	0.03	a)
CND10006FQL8	2.3500 % EXIMCH 2.35 05/15/25 2302	0	1'000	0	1'000 CNY	100.36%	122'644.83	0.01	a)
CND10006GVP7	2.8200 % SDBC 2.82 05/22/33 2310	0	4'000	0	4'000 CNY	102.77%	502'359.26	0.05	a)
CND10006GRG4	2.5200 % SDBC 2.52 05/25/28 2308	0	4'000	0	4'000 CNY	100.98%	493'633.50	0.05	a)
CND10006JDR5	2.6300 % ADBCH 2.63 06/07/28 2307	0	2'000	0	2'000 CNY	101.19%	247'315.37	0.03	a)
CND10006KTX7	2.8300 % ADBCH 2.83 06/16/33 2310	0	4'000	0	4'000 CNY	102.56%	501'332.70	0.05	a)
CND10006NGN9	2.2500 % SDBC 2 1/4 07/06/26 2307	0	2'000	0	2'000 CNY	100.15%	244'773.41	0.03	a)
CND10006NHN7	2.8500 % EXIMCH 2.85 07/07/33 2311	0	3'000	0	3'000 CNY	102.72%	376'615.46	0.04	a)
CND10006XGW9	2.1500 % ADBCH 2.15 08/24/25 2312	0	1'000	0	1'000 CNY	100.03%	122'246.16	0.01	a)
CND10006YXS0	2.3500 % ADBCH 2.35 09/07/26 2313	0	1'000	0	1'000 CNY	100.33%	122'616.46	0.01	a)
CND10006ZG38	2.6900 % SDBC 2.69 09/11/33 2315	0	1'000	0	1'000 CNY	101.55%	124'100.08	0.01	a)
CND10006ZGB8	2.5700 % ADBCH 2.57 09/13/28 2315	0	1'000	0	1'000 CNY	101.00%	123'432.82	0.01	a)
CND1000716X4	3.0000 % CGB 3 10/15/53 INBK	0	1'000	0	1'000 CNY	111.30%	136'019.17	0.01	a)
CND100072G80	2.8500 % ADBCH 2.85 10/20/33 2320	0	1'000	0	1'000 CNY	102.77%	125'598.37	0.01	a)
CND100076348	2.6700 % CGB 2.67 11/25/33 INBK	0	1'000	0	1'000 CNY	102.76%	125'580.04	0.01	a)
CNY							48'283'958.16	4.94	
CZ0001001796	4.2000 % CZGB 4.2 12/04/36 49	600	0	0	600 CZK	102.92%	23'252.00	0.00	a)
CZ0001004469	1.0000 % CZGB 1 06/26/26 95	3'000	0	0	3'000 CZK	93.97%	106'154.46	0.01	a)
CZ0001004477	0.9500 % CZGB 0.95 05/15/30 94	1'000	0	0	1'000 CZK	85.17%	32'070.15	0.00	a)
CZ0001004600	0.4500 % CZGB 0.45 10/25/23 97	800	0	800	0 CZK	0.00%	0.00	0.00	
CZ0001005037	0.2500 % CZGB 0 1/4 02/10/27 100	5'400	1'600	0	7'000 CZK	90.58%	238'753.21	0.02	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	2'600	0	0	2'600 CZK	85.74%	83'937.49	0.01	a)
CZ0001005870	1.2500 % CZGB 1 1/4 02/14/25 120	1'000	0	0	1'000 CZK	97.16%	36'582.59	0.00	a)
CZ0001005888	1.2000 % CZGB 1.2 03/13/31 121	5'300	0	0	5'300 CZK	84.75%	169'127.64	0.02	a)
CZ0001005920	1.5000 % CZGB 1 1/2 04/24/40 125	1'400	0	0	1'400 CZK	70.89%	37'370.46	0.00	a)
CZ0001006076	0.0500 % CZGB 0.05 11/29/29 130	3'400	3'000	0	6'400 CZK	81.77%	197'062.73	0.02	a)
CZ0001006167	0.0000 % CZGB 0 12/12/24 135	3'300	0	0	3'300 CZK	96.50%	119'907.41	0.01	a)
CZ0001006233	1.7500 % CZGB 1 3/4 06/23/32 138	1'500	1'600	0	3'100 CZK	85.81%	100'165.69	0.01	a)
CZ0001006316	1.9500 % CZGB 1.95 07/30/37 142	1'500	0	0	1'500 CZK	79.06%	44'652.56	0.00	a)
CZ0001006696	5.5000 % CZGB 5 1/2 12/12/28 149	0	2'200	0	2'200 CZK	108.13%	89'574.04	0.01	a)
CZ0001006894	4.9000 % CZGB 4.9 04/14/34 151	0	1'800	0	1'800 CZK	108.36%	73'441.71	0.01	a)
CZK							1'352'052.14	0.14	
DK0002043744	1.0000 % NDAFH 1 10/01/24 SDRO	250	0	0	250 DKK	98.45%	31'464.10	0.00	a)
DK0002045798	1.0000 % NDAFH 1 04/01/25 CC2	0	600	0	600 DKK	97.48%	74'763.72	0.01	a)
DK0002047810	1.0000 % NDAFH 1 04/01/26	250	0	0	250 DKK	95.75%	30'601.23	0.00	a)
DK0002049352	1.0000 % NDAFH 1 10/01/26	0	400	0	400 DKK	94.93%	48'539.61	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DK0002051929	1.0000 % NDAFH 1 04/01/27 CC2	250	0	0	250 DKK	94.13%	30'080.95	0.00	a)
DK0009296469	1.0000 % RDKRE 1 01/01/25 10F	500	0	0	500 DKK	97.82%	62'521.06	0.01	a)
DK0009296543	1.0000 % RDKRE 1 01/01/26 10F	700	0	0	700 DKK	95.95%	85'857.04	0.01	a)
DK0009507931	2.0000 % NYKRE 2 01/01/26 13H	600	200	0	800 DKK	97.80%	100'015.28	0.01	a)
DK0009511297	1.0000 % NYKRE 1 01/01/27 13H	500	200	0	700 DKK	94.51%	84'569.38	0.01	a)
DK0009515363	1.0000 % NYKRE 1 01/01/28 13H	400	0	0	400 DKK	92.81%	47'458.66	0.00	a)
DK0009531485	1.0000 % NYKRE 1 07/01/26 13H	500	0	0	500 DKK	95.21%	60'854.76	0.01	a)
DK0009798480	2.0000 % NYKRE 2 01/01/25 13H	500	0	0	500 DKK	98.63%	63'043.25	0.01	a)
DK0009918138	7.0000 % DGB 7 11/10/24	250	0	0	250 DKK	102.38%	32'718.78	0.00	a)
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	1'540	300	0	1'840 DKK	124.70%	293'318.98	0.03	a)
DK0009923054	1.5000 % DGB 1 1/2 11/15/23	180	0	180	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	670	350	0	1'020 DKK	98.15%	127'970.63	0.01	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	1'060	0	0	1'060 DKK	93.10%	126'151.62	0.01	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	790	0	0	790 DKK	90.00%	90'893.09	0.01	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	870	0	0	870 DKK	54.08%	60'140.33	0.01	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	930	400	0	1'330 DKK	83.36%	141'723.18	0.01	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	340	200	0	540 DKK	97.64%	67'397.11	0.01	a)
DK0009924375	0.0000 % DGB 0 11/15/31 G	400	0	0	400 DKK	83.45%	42'670.56	0.00	a)
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	0	400	0	400 DKK	97.93%	50'073.60	0.01	a)
DKK							1'752'826.92	0.18	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	85	70	0	155 EUR	110.87%	163'757.49	0.02	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	246	60	30	276 EUR	111.91%	294'308.09	0.03	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	72	70	0	142 EUR	103.56%	140'129.16	0.01	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	57	30	0	87 EUR	115.14%	95'447.90	0.01	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	94	65	0	159 EUR	100.63%	152'464.48	0.02	a)
AT0000A105W3	1.7500 % RAGB 1 3/4 10/20/23	111	0	111	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	79	80	0	159 EUR	95.58%	144'808.75	0.01	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	86	0	0	86 EUR	98.81%	80'974.43	0.01	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	224	0	0	224 EUR	97.05%	207'142.82	0.02	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	152	55	0	207 EUR	94.85%	187'088.65	0.02	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	133	30	0	163 EUR	74.14%	115'151.13	0.01	a)
AT0000A1PE50	0.0000 % RAGB 0 07/15/23	64	0	64	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	20	55	0	75 EUR	60.19%	43'013.39	0.00	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	273	0	0	273 EUR	93.19%	242'411.42	0.02	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	118	0	0	118 EUR	75.69%	85'102.64	0.01	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	212	0	0	212 EUR	92.65%	187'153.35	0.02	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	136	100	0	236 EUR	89.75%	201'827.98	0.02	a)
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	104	0	70	34 EUR	98.64%	31'957.42	0.00	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	101	130	0	231 EUR	85.08%	187'263.74	0.02	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	160	0	0	160 EUR	58.01%	88'439.77	0.01	a)
AT0000A2EJZ6	0.0000 % RAGB 0 04/20/23	21	0	21	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	59	0	0	59 EUR	45.83%	25'765.68	0.00	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	55	60	0	115 EUR	60.34%	66'121.53	0.01	a)
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	291	0	0	291 EUR	82.58%	228'971.44	0.02	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	37	30	0	67 EUR	45.16%	28'830.94	0.00	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	55	40	0	95 EUR	96.39%	87'253.29	0.01	a)
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	50	80	0	130 EUR	71.20%	88'193.93	0.01	a)
AT0000A2UXM1	0.0100 % ERSTBK 0.01 07/12/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.01%	82'911.34	0.01	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	60	140	0	200 EUR	88.27%	168'223.94	0.02	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	140	70	0	210 EUR	86.38%	172'849.14	0.02	a)
AT0000A2XG57	1.3750 % HYN0E 1 3/8 04/14/25	100	0	0	100 EUR	97.00%	92'425.88	0.01	a)
AT0000A2XLA5	1.2500 % RFLBOB 1 1/4 04/26/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.73%	89'314.71	0.01	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	50	30	0	80 EUR	78.47%	59'815.92	0.01	a)
AT0000A306J4	2.5000 % ERSTBK 2 1/2 09/19/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.84%	91'323.39	0.01	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	109	0	0	109 EUR	97.98%	101'770.38	0.01	a)
AT0000A30ZH4	3.2500 % VORHYP 3 1/4 02/19/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	120	170	0	290 EUR	100.24%	276'988.33	0.03	a)
AT0000A33SH3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	60	0	60 EUR	100.92%	57'700.71	0.01	a)
AT0000A33SK7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	0	95	0	95 EUR	100.61%	91'072.50	0.01	a)
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	0	70	0	70 EUR	104.04%	69'393.92	0.01	a)
AT0000A39UW5	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/34	0	100	0	100 EUR	100.00%	95'287.39	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AT000B049929	2.3750 % BACA 2 3/8 09/20/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.03%	92'460.18	0.01	a)
AT000B093273	1.3750 % RFLBST 1 3/8 05/11/33	0	100	0	100 EUR	85.06%	81'052.26	0.01	a)
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	340	50	0	390 EUR	110.53%	410'764.01	0.04	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	331	30	0	361 EUR	118.70%	408'324.08	0.04	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	256	30	0	286 EUR	113.10%	308'230.83	0.03	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	121	120	30	211 EUR	103.04%	207'174.59	0.02	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	196	0	0	196 EUR	108.54%	202'718.62	0.02	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	139	30	0	169 EUR	106.42%	171'374.27	0.02	a)
BE0000332412	2.6000 % BGB 2.6 06/22/24 72	148	0	148	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	82	80	0	162 EUR	100.48%	155'101.89	0.02	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	357	30	0	387 EUR	96.88%	357'245.62	0.04	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	265	200	140	325 EUR	88.37%	273'670.49	0.03	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	80	80	0	160 EUR	85.61%	130'522.15	0.01	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	189	100	0	289 EUR	95.80%	263'806.18	0.03	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	185	40	0	225 EUR	72.02%	154'401.41	0.02	a)
BE0000339482	0.2000 % BGB 0.2 10/22/23 79	53	0	53	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	149	0	0	149 EUR	75.30%	106'914.92	0.01	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	265	50	0	315 EUR	93.82%	281'614.49	0.03	a)
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	105	0	105	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	82	70	30	122 EUR	77.65%	90'268.34	0.01	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	65	60	0	125 EUR	82.05%	97'734.87	0.01	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	144	150	0	294 EUR	92.35%	258'722.02	0.03	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	107	80	0	187 EUR	87.43%	155'781.90	0.02	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	315	0	0	315 EUR	91.20%	273'744.34	0.03	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	109	90	0	199 EUR	71.21%	135'027.31	0.01	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	155	90	0	245 EUR	84.91%	198'218.51	0.02	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	78	120	0	198 EUR	64.45%	121'604.06	0.01	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	108	90	0	198 EUR	90.58%	170'892.45	0.02	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	139	40	0	179 EUR	81.05%	138'240.43	0.01	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	64	90	0	154 EUR	42.20%	61'930.39	0.01	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	178	90	0	268 EUR	81.82%	208'938.32	0.02	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	98	80	0	178 EUR	63.74%	108'114.87	0.01	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	60	40	0	100 EUR	94.92%	90'442.93	0.01	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	149	200	0	349 EUR	100.91%	335'579.24	0.03	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	123	120	45	198 EUR	97.81%	184'531.47	0.02	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	0	70	0	70 EUR	101.84%	67'927.15	0.01	a)
BE0002483585	0.7500 % CCBGGB 0 3/4 02/10/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.17%	92'587.87	0.01	a)
BE0002736172	0.1250 % FLEMSH 0 1/8 10/15/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	69.73%	66'444.56	0.01	a)
BE0002778596	0.5000 % WALLOO 0 1/2 06/22/37 EMTN	100	0	0	100 EUR	68.47%	65'239.16	0.01	a)
BE0002816974	0.3750 % WALLOO 0 3/8 10/22/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.18%	77'358.88	0.01	a)
BE0002826072	0.3000 % FLEMSH 0.3 10/20/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.22%	77'391.28	0.01	a)
BE0002859404	1.5000 % INGB 1 1/2 05/19/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.31%	87'960.66	0.01	a)
BE0002889716	3.2500 % FLEMSH 3 1/4 01/12/43 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.76%	91'244.30	0.01	a)
BE0002890722	3.0000 % FLEMSH 3 10/12/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.38%	93'741.81	0.01	a)
BE0002923044	3.5000 % WALLOO 3 1/2 03/15/43 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.08%	92'503.06	0.01	a)
BE0002924059	3.1250 % KBC 3 1/8 02/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.64%	94'945.30	0.01	a)
BE0002933142	3.7500 % LCFB 3 3/4 06/22/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.47%	98'591.98	0.01	a)
BE0002939206	3.8750 % FLUVIU 3 7/8 05/09/33	0	100	0	100 EUR	100.71%	95'960.12	0.01	a)
BE0002963446	4.1250 % CCBGGB 4 1/8 09/12/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.51%	97'677.22	0.01	a)
BE6326767397	0.0100 % ARGSPA 0.01 02/11/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	80.04%	76'271.64	0.01	a)
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	100	0	100 EUR	102.07%	97'264.62	0.01	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	120	100	0	220 EUR	86.25%	180'811.72	0.02	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	80	50	0	130 EUR	95.53%	118'340.11	0.01	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	106	70	0	176 EUR	52.16%	87'472.86	0.01	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	100	50	0	150 EUR	84.30%	120'497.82	0.01	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	40	110	0	150 EUR	95.96%	137'159.46	0.01	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	0	130	0	130 EUR	85.07%	105'375.37	0.01	a)
DE0001053536	0.0100 % BAYERN 0.01 05/07/29 134	50	0	0	50 EUR	86.61%	41'266.52	0.00	a)
DE0001053577	0.0100 % BAYERN 0.01 01/17/25	60	0	0	60 EUR	96.98%	55'445.81	0.01	a)
DE0001102325	2.0000 % DBR 2 08/15/23	179	0	179	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	169	0	169	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	444	250	150	544 EUR	98.94%	512'858.30	0.05 a)	
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	190	0	190	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	219	0	219	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	433	0	0	433 EUR	97.31%	401'511.98	0.04 a)	
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	290	160	0	450 EUR	97.02%	416'036.51	0.04 a)	
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	473	100	0	573 EUR	95.55%	521'683.24	0.05 a)	
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	551	0	0	551 EUR	93.62%	491'562.27	0.05 a)	
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	525	0	0	525 EUR	93.36%	467'026.25	0.05 a)	
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	491	110	0	601 EUR	93.38%	534'765.58	0.05 a)	
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	535	120	0	655 EUR	76.70%	478'695.59	0.05 a)	
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	289	200	0	489 EUR	92.67%	431'823.75	0.04 a)	
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	471	50	0	521 EUR	90.93%	451'414.09	0.05 a)	
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	485	100	0	585 EUR	90.12%	502'362.02	0.05 a)	
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	343	150	0	493 EUR	88.03%	413'539.86	0.04 a)	
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	397	380	0	777 EUR	51.99%	384'914.15	0.04 a)	
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	502	0	0	502 EUR	87.08%	416'564.10	0.04 a)	
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	367	200	0	567 EUR	86.13%	465'325.75	0.05 a)	
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	279	160	0	439 EUR	76.27%	319'062.01	0.03 a)	
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	385	30	0	415 EUR	91.24%	360'797.57	0.04 a)	
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	471	0	0	471 EUR	85.19%	382'344.08	0.04 a)	
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	237	230	0	467 EUR	74.21%	330'223.03	0.03 a)	
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	254	190	0	444 EUR	89.41%	378'288.72	0.04 a)	
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	373	190	0	563 EUR	84.25%	452'000.25	0.05 a)	
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	382	100	0	482 EUR	49.60%	227'784.77	0.02 a)	
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	332	230	0	562 EUR	83.23%	445'724.39	0.05 a)	
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	110	320	0	430 EUR	81.76%	335'015.60	0.03 a)	
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	458	60	0	518 EUR	95.06%	469'200.20	0.05 a)	
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	70	450	0	520 EUR	84.92%	420'763.19	0.04 a)	
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	215	260	0	475 EUR	98.42%	445'477.27	0.05 a)	
DE0001104859	0.0000 % BKO 0 09/15/23	166	0	166	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104867	0.0000 % BKO 0 12/15/23	130	0	130	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104875	0.0000 % BKO 0 03/15/24	171	0	171	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104891	0.4000 % BKO 0.4 09/13/24	30	220	150	100 EUR	98.30%	93'671.29	0.01 a)	
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	156	80	0	236 EUR	98.99%	222'609.18	0.02 a)	
DE0001134922	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/24	135	0	135	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	168	60	0	228 EUR	112.24%	243'858.41	0.02 a)	
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	200	100	0	300 EUR	111.18%	317'810.43	0.03 a)	
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	138	110	0	248 EUR	109.19%	258'027.71	0.03 a)	
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	131	60	0	191 EUR	120.64%	219'572.96	0.02 a)	
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	307	130	0	437 EUR	119.45%	497'418.45	0.05 a)	
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	369	70	0	439 EUR	121.15%	506'781.23	0.05 a)	
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	466	70	60	476 EUR	116.31%	527'550.16	0.05 a)	
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	175	140	0	315 EUR	121.21%	363'830.84	0.04 a)	
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	362	0	0	362 EUR	128.84%	444'439.37	0.05 a)	
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	218	150	0	368 EUR	109.65%	384'513.90	0.04 a)	
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	486	50	0	536 EUR	98.76%	504'417.36	0.05 a)	
DE0001141786	0.0000 % OBL 0 10/13/23 178	165	0	165	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	182	0	182	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	179	160	0	339 EUR	97.79%	315'891.79	0.03 a)	
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	422	0	0	422 EUR	96.50%	388'026.61	0.04 a)	
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	469	0	0	469 EUR	95.39%	426'286.70	0.04 a)	
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	288	200	0	488 EUR	94.31%	438'548.19	0.04 a)	
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	214	250	0	464 EUR	93.31%	412'572.13	0.04 a)	
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	291	80	0	371 EUR	92.31%	326'323.46	0.03 a)	
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	387	140	0	527 EUR	95.83%	481'234.09	0.05 a)	
DE0001789295	0.0100 % SAXONY 0.01 10/15/27 130	100	0	0	100 EUR	90.13%	85'887.19	0.01 a)	
DE000A11QEJ1	1.6250 % BERGER 1 5/8 06/03/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A11QTD2	0.6250 % KFW 0 5/8 01/15/25	50	0	0	50 EUR	97.52%	46'463.55	0.00 a)	
DE000A11QTF7	0.3750 % KFW 0 3/8 04/23/30 EMTN	0	80	0	80 EUR	86.47%	65'915.14	0.01 a)	
DE000A14J3F7	0.2500 % BERGER 0 1/4 04/22/25 465	50	0	0	50 EUR	96.47%	45'962.33	0.00 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000A14JZH9	0.0100 % BADWUR 0.01 04/08/25	40	0	0	40 EUR	96.31%	36'706.97	0.00	a)
DE000A14JZL1	0.0100 % BADWUR 0.01 07/09/32	40	0	0	40 EUR	79.31%	30'227.75	0.00	a)
DE000A14JZN7	0.0100 % BADWUR 0.01 08/04/27	60	60	0	60 EUR	90.61%	51'806.17	0.01	a)
DE000A14JZF2	0.0100 % BADWUR 0.01 09/02/30	50	0	0	50 EUR	83.51%	39'789.55	0.00	a)
DE000A161RT4	3.2500 % BYLABO 3 1/4 03/15/35	0	70	0	70 EUR	102.90%	68'633.52	0.01	a)
DE000A168Y55	0.3750 % KFW 0 3/8 03/09/26	50	30	0	80 EUR	94.82%	72'278.87	0.01	a)
DE000A1R0709	1.5000 % KFW 1 1/2 06/11/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQC36	0.1250 % HESSEN 0 1/8 01/25/24 1701	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1RQCY2	0.3750 % HESSEN 0 3/8 07/06/26 1605	100	0	0	100 EUR	93.96%	89'531.97	0.01	a)
DE000A1RQDB8	1.3000 % HESSEN 1.3 10/10/33 1803	0	40	0	40 EUR	86.97%	33'148.14	0.00	a)
DE000A1RQDR4	0.0000 % HESSEN 0 03/10/25 2001	60	0	0	60 EUR	96.52%	55'181.10	0.01	a)
DE000A1RQDW4	0.0100 % HESSEN 0.01 03/11/30 2006	90	0	0	90 EUR	84.71%	72'648.59	0.01	a)
DE000A1RQEG5	2.6250 % HESSEN 2 5/8 09/10/27	0	40	0	40 EUR	98.97%	37'721.22	0.00	a)
DE000A1RQEH3	2.8750 % HESSEN 2 7/8 01/10/33 2301	0	60	0	60 EUR	100.28%	57'333.09	0.01	a)
DE000A1RQEN1	3.2500 % HESSEN 3 1/4 10/05/28	0	40	0	40 EUR	101.55%	38'707.27	0.00	a)
DE000A254PM6	0.0000 % KFW 0 02/18/25 EMTN	70	0	0	70 EUR	96.70%	64'500.68	0.01	a)
DE000A254PP9	0.0000 % KFW 0 03/31/27 EMTN	110	0	0	110 EUR	91.55%	95'958.02	0.01	a)
DE000A254PS3	0.0100 % KFW 0.01 03/31/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.38%	45'917.54	0.00	a)
DE000A254RB5	0.0000 % NIESA 0 02/11/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.63%	87'312.70	0.01	a)
DE000A289CL2	0.0100 % LBANK 0.01 01/20/31 5614	80	0	0	80 EUR	82.54%	62'920.80	0.01	a)
DE000A289F29	0.0000 % KFW 0 12/15/27 EMTN	70	0	0	70 EUR	89.87%	59'946.94	0.01	a)
DE000A289K63	0.0100 % BERGER 0.01 07/02/30	50	0	0	50 EUR	83.77%	39'912.00	0.00	a)
DE000A289KG5	0.0100 % IBB 0.01 07/15/27 216	100	0	0	100 EUR	90.54%	86'276.92	0.01	a)
DE000A289LD0	0.0100 % BERGER 0.01 10/26/28 527	100	0	0	100 EUR	87.73%	83'596.46	0.01	a)
DE000A289NY2	0.0000 % NIESA 0 09/15/25 895	50	0	0	50 EUR	95.18%	45'345.34	0.00	a)
DE000A289PA7	0.0100 % DZHYP 0.01 06/23/28 EMTN	70	0	0	70 EUR	87.77%	58'542.20	0.01	a)
DE000A289PC3	0.0100 % DZHYP 0.01 09/12/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	94.99%	45'257.20	0.00	a)
DE000A289RK2	0.0000 % KFW 0 09/17/30 EMTN	110	0	0	110 EUR	83.35%	87'361.97	0.01	a)
DE000A289T98	0.0100 % NIESA 0.01 04/15/24	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2BPPB50	0.0000 % KFW 0 09/15/23	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DAJ57	0.1250 % KFW 0 1/8 10/04/24	40	0	0	40 EUR	97.96%	37'337.02	0.00	a)
DE000A2DAJV5	0.2500 % LANDER 0 1/4 03/18/24 52	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DAR24	0.1250 % KFW 0 1/8 01/15/24	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2DAR65	0.6250 % KFW 0 5/8 02/22/27 GMTN	80	0	0	80 EUR	93.57%	71'330.56	0.01	a)
DE000A2GSE59	1.1250 % KFW 1 1/8 09/15/32 EMTN	40	0	0	40 EUR	87.35%	33'292.60	0.00	a)
DE000A2GSFA2	0.5000 % KFW 0 1/2 09/15/27	90	0	0	90 EUR	92.09%	78'975.93	0.01	a)
DE000A2GSNR0	0.6250 % KFW 0 5/8 01/07/28	60	0	0	60 EUR	91.97%	52'582.01	0.01	a)
DE000A2GSNW0	0.3750 % KFW 0 3/8 04/23/25	100	0	0	100 EUR	96.63%	92'077.12	0.01	a)
DE000A2LQH10	0.2500 % KFW 0 1/4 09/15/25	70	50	0	120 EUR	95.63%	109'346.80	0.01	a)
DE000A2LQHT2	1.1250 % KFW 1 1/8 05/09/33 EMTN	40	0	0	40 EUR	86.24%	32'869.14	0.00	a)
DE000A2LQKN9	0.3750 % LANDER 0 3/8 04/17/25 54	50	0	0	50 EUR	96.63%	46'039.04	0.00	a)
DE000A2LQPB3	0.0000 % HAMBURG 0 04/07/26	50	0	0	50 EUR	93.72%	44'653.07	0.00	a)
DE000A2LQPD9	0.0100 % HAMBURG 0.01 06/30/28 EMTN	70	0	0	70 EUR	88.45%	58'995.77	0.01	a)
DE000A2LQPF4	0.0100 % HAMBURG 0.01 11/05/35	80	0	0	80 EUR	71.30%	54'350.18	0.01	a)
DE000A2LQSH4	0.7500 % KFW 0 3/4 06/28/28 GMTN	70	40	0	110 EUR	91.64%	96'058.65	0.01	a)
DE000A2LQSN2	0.7500 % KFW 0 3/4 01/15/29 EMTN	90	40	0	130 EUR	90.68%	112'328.47	0.01	a)
DE000A2LQSP7	0.0000 % KFW 0 04/02/24 EMTN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2NB9Y6	0.0100 % BERGER 0.01 05/18/27 517	0	70	0	70 EUR	91.07%	60'746.70	0.01	a)
DE000A2NB9Z3	0.1250 % BERGER 0 1/8 06/04/35 518	80	0	0	80 EUR	73.24%	55'829.82	0.01	a)
DE000A2NBGG9	0.7500 % LANDER 0 3/4 09/25/28 55	0	50	0	50 EUR	91.08%	43'396.21	0.00	a)
DE000A2TR190	2.1250 % IBBSH 2 1/8 09/06/30	100	0	0	100 EUR	95.55%	91'044.20	0.01	a)
DE000A2TR6J9	0.3750 % BRABUR 0 3/8 01/29/35 EMTN	50	0	0	50 EUR	76.41%	36'406.34	0.00	a)
DE000A2TSDW4	0.0100 % DZHYP 0.01 01/15/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.32%	43'509.13	0.00	a)
DE000A2TSTRO	0.8750 % KFW 0 7/8 07/04/39 EMTN	65	0	0	65 EUR	73.70%	45'647.26	0.00	a)
DE000A2TSTS8	0.0000 % KFW 0 07/04/24 EMTN	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2TSTU4	0.0000 % KFW 0 09/30/26 EMTN	70	100	0	170 EUR	92.73%	150'208.63	0.02	a)
DE000A2YNVY3	0.1000 % PBBGR 0.1 01/21/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.09%	82'989.47	0.01	a)
DE000A2YNWA1	0.6250 % INGDB 0 5/8 02/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.94%	84'746.59	0.01	a)
DE000A2YNZ16	0.0500 % KFW 0.05 09/29/34 EMTN	65	0	0	65 EUR	74.19%	45'953.23	0.00	a)
DE000A30V216	3.1250 % IBB 3 1/8 03/01/33	0	100	0	100 EUR	101.71%	96'913.96	0.01	a)
DE000A30V5D1	3.0000 % NIESA 3 01/10/33	0	60	0	60 EUR	101.10%	57'801.33	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000A30V877	2.8750 % NIESA 2 7/8 04/18/28	0	80	0	80 EUR	99.85%	76'114.80	0.01	a)
DE000A30V8H6	2.8750 % BAUSCH 2 7/8 06/24/32	100	0	0	100 EUR	98.66%	94'014.33	0.01	a)
DE000A30V9J0	3.1250 % KFW 3 1/8 06/07/30 EMTN	0	80	0	80 EUR	101.82%	77'615.78	0.01	a)
DE000A30V9M4	2.8750 % KFW 2 7/8 06/07/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.23%	95'506.55	0.01	a)
DE000A30VM78	2.8750 % KFW 2 7/8 12/28/29 EMTN	70	30	0	100 EUR	100.39%	95'659.01	0.01	a)
DE000A30VPC2	2.2500 % DB 2 1/4 09/20/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.01%	92'437.31	0.01	a)
DE000A30VUG3	2.5000 % KFW 2 1/2 11/19/25 EMTN	60	0	0	60 EUR	98.93%	56'563.54	0.01	a)
DE000A30VUK5	2.7500 % KFW 2 3/4 03/15/28 EMTN	90	40	0	130 EUR	99.70%	123'499.50	0.01	a)
DE000A30WF27	3.0000 % PBBGR 3 01/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.67%	93'066.21	0.01	a)
DE000A351MM7	2.8750 % KFW 2 7/8 05/29/26 EMTN	0	90	0	90 EUR	99.63%	85'442.19	0.01	a)
DE000A351MT2	3.1250 % KFW 3 1/8 10/10/28 EMTN	0	110	0	110 EUR	101.26%	106'139.96	0.01	a)
DE000A351P20	3.0000 % LANDER 3 04/26/30 63	0	50	0	50 EUR	100.95%	48'096.31	0.00	a)
DE000A351PF4	3.0000 % BERGER 3 07/11/31	0	70	0	70 EUR	100.99%	67'364.85	0.01	a)
DE000A352B55	3.0000 % THRGN 3 11/15/28	0	70	0	70 EUR	100.60%	67'100.05	0.01	a)
DE000A3E5LU1	0.0000 % KFW 0 11/09/28 EMTN	70	70	0	140 EUR	87.76%	117'080.40	0.01	a)
DE000A3E5SQ4	3.0000 % BRABUR 3 02/27/32	0	100	0	100 EUR	101.08%	96'318.40	0.01	a)
DE000A3E5UY4	0.0100 % DZHYP 0.01 10/26/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.91%	43'788.33	0.00	a)
DE000A3E5V88	0.4500 % BREMEN 0.45 03/15/29 269	100	0	0	100 EUR	88.87%	84'680.84	0.01	a)
DE000A3E5XK7	0.0000 % KFW 0 11/15/24 EMTN	70	0	0	70 EUR	97.51%	65'043.63	0.01	a)
DE000A3E5XN1	0.1250 % KFW 0 1/8 01/09/32 EMTN	60	50	0	110 EUR	81.23%	85'138.80	0.01	a)
DE000A3H20D1	0.0100 % NIESA 0.01 11/25/27 901	40	0	0	40 EUR	89.84%	34'240.91	0.00	a)
DE000A3H2499	0.0100 % NIESA 0.01 03/17/26 903	80	0	0	80 EUR	93.90%	71'577.55	0.01	a)
DE000A3H24E1	0.0100 % NIESA 0.01 02/19/29	80	0	0	80 EUR	86.89%	66'239.12	0.01	a)
DE000A3H25B4	0.0100 % THRGN 0.01 03/24/31	50	0	0	50 EUR	82.22%	39'173.04	0.00	a)
DE000A3H2TK9	0.0100 % DZHYP 0.01 03/29/30 1234	0	60	0	60 EUR	83.41%	47'689.15	0.00	a)
DE000A3H2TQ6	0.0100 % DZHYP 0.01 04/20/29 EMTN	0	70	0	70 EUR	85.74%	57'190.15	0.01	a)
DE000A3H2W42	0.0100 % NIESA 0.01 08/13/30 898	100	0	0	100 EUR	83.51%	79'571.48	0.01	a)
DE000A3H2Y08	0.1000 % BERGER 0.1 01/18/41 530	70	0	0	70 EUR	60.70%	40'490.68	0.00	a)
DE000A3H2YH5	0.5000 % BREMEN 0 1/2 05/06/41 258	50	0	0	50 EUR	64.77%	30'861.03	0.00	a)
DE000A3H2ZF6	0.0000 % KFW 0 01/10/31 EMTN	60	50	0	110 EUR	82.61%	86'586.32	0.01	a)
DE000A3H3E76	0.0000 % KFW 0 06/15/26 EMTN	120	0	0	120 EUR	93.40%	106'798.03	0.01	a)
DE000A3H3ETO	0.1250 % THRGN 0 1/8 01/13/51	60	0	0	60 EUR	45.37%	25'940.53	0.00	a)
DE000A3H3F67	0.0100 % LANDER 0.01 02/04/31 60	50	0	0	50 EUR	82.46%	39'285.95	0.00	a)
DE000A3H3GK4	2.7500 % SAARLD 2 3/4 01/18/30	70	0	0	70 EUR	99.65%	66'467.71	0.01	a)
DE000A3H3KE9	0.3750 % KFW 0 3/8 05/20/36 EMTN	75	35	0	110 EUR	73.81%	77'362.41	0.01	a)
DE000A3MP5P6	0.0100 % LANDER 0.01 10/08/27 61	50	0	0	50 EUR	90.19%	42'967.89	0.00	a)
DE000A3MP619	0.7500 % DZHYP 0 3/4 11/21/29 EMTN	50	0	0	50 EUR	88.07%	41'958.31	0.00	a)
DE000A3MP7H9	0.0000 % KFW 0 04/30/27 EMTN	70	30	0	100 EUR	91.36%	87'053.52	0.01	a)
DE000A3MP7J5	0.1250 % KFW 0 1/8 06/30/25 EMTN	90	0	0	90 EUR	95.92%	82'260.52	0.01	a)
DE000A3MP7K3	1.1250 % KFW 1 1/8 03/31/37 EMTN	90	50	0	140 EUR	80.27%	107'080.46	0.01	a)
DE000A3MP7P2	0.0100 % SACHAN 0.01 11/09/26	100	0	0	100 EUR	92.34%	87'988.30	0.01	a)
DE000A3MQNG3	0.1250 % NIESA 0 1/8 01/09/32	70	0	0	70 EUR	81.04%	54'056.50	0.01	a)
DE000A3MQP00	0.3500 % SACHAN 0.35 02/09/32	40	0	0	40 EUR	82.56%	31'468.78	0.00	a)
DE000A3MQU11	3.0000 % DZHYP 3 10/29/27 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.58%	47'445.02	0.00	a)
DE000A3MQUU9	1.2500 % LANDER 1 1/4 05/04/29 62	60	0	0	60 EUR	92.44%	52'850.15	0.01	a)
DE000A3MQUX3	2.5000 % DZHYP 2 1/2 11/28/31 EMTN	0	38	0	38 EUR	96.50%	34'942.96	0.00	a)
DE000A3MQVV5	1.2500 % KFW 1 1/4 06/30/27 EMTN	70	40	0	110 EUR	94.88%	99'453.68	0.01	a)
DE000A3MQYP1	2.7500 % BERGER 2 3/4 02/14/33 546	0	70	0	70 EUR	99.23%	66'188.23	0.01	a)
DE000A3S1ZT2	2.6250 % WIBANK 2 5/8 01/26/33	100	0	0	100 EUR	98.18%	93'556.95	0.01	a)
DE000AAR0272	0.0100 % AARB 0.01 08/03/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.43%	87'120.22	0.01	a)
DE000AAR0363	2.3750 % AARB 2 3/8 09/14/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.08%	89'649.17	0.01	a)
DE000BHY0GK6	1.2500 % BHH 1 1/4 08/25/25 EMTN	35	0	0	35 EUR	96.86%	32'302.37	0.00	a)
DE000BHY0GM2	3.0000 % BHH 3 01/10/33 EMTN	0	50	0	50 EUR	100.04%	47'662.75	0.00	a)
DE000BHY0H34	0.1250 % BHH 0 1/8 01/18/30 EMTN	30	0	0	30 EUR	84.55%	24'169.32	0.00	a)
DE000BHY0HZ2	0.0100 % BHH 0.01 08/24/26 EMTN	30	0	0	30 EUR	92.41%	26'415.64	0.00	a)
DE000BHY0JW5	3.0000 % BHH 3 10/25/27	60	0	0	60 EUR	99.64%	56'964.89	0.01	a)
DE000BHY0SBO	1.7500 % BHH 1 3/4 05/10/32 EMTN	25	0	0	25 EUR	90.89%	21'651.89	0.00	a)
DE000BLB6JD3	0.5000 % BYLAN 0 1/2 03/19/25 EMTN	0	60	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JE1	0.6250 % BYLAN 0 5/8 07/19/27 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JM4	0.2000 % BYLAN 0.2 05/20/30 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JT9	3.1250 % BYLAN 3 1/8 10/19/27 EMTN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	0	80	0	80 EUR	99.13%	75'568.23	0.01	a)
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	0	150	0	150 EUR	99.98%	142'898.20	0.01	a)
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	0	320	0	320 EUR	100.15%	305'383.11	0.03	a)
DE000BU22049	2.5000 % BKO 2 1/2 03/19/26 2Y	0	100	0	100 EUR	99.22%	94'544.14	0.01	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	244	250	0	494 EUR	98.86%	465'348.72	0.05	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	0	550	0	550 EUR	99.71%	522'560.77	0.05	a)
DE000BU25026	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 189	0	60	0	60 EUR	98.43%	56'274.81	0.01	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	220	0	220 EUR	100.10%	209'841.88	0.02	a)
DE000BU2D004	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/54	0	120	0	120 EUR	99.27%	113'508.99	0.01	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	132	530	0	662 EUR	99.44%	627'301.50	0.06	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	0	600	70	530 EUR	101.75%	513'871.24	0.05	a)
DE000BU2Z023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	0	170	0	170 EUR	98.17%	159'030.61	0.02	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	0	120	0	120 EUR	99.50%	113'775.42	0.01	a)
DE000CZ40MU7	0.6250 % CMZB 0 5/8 05/28/25 EMTN	30	0	0	30 EUR	96.47%	27'577.40	0.00	a)
DE000CZ40NNO	0.1250 % CMZB 0 1/8 01/09/24 EMTN	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ43ZJ6	2.7500 % CMZB 2 3/4 12/08/25 EMTN	0	70	0	70 EUR	98.96%	66'007.47	0.01	a)
DE000CZ43ZS7	2.8750 % CMZB 2 7/8 04/28/26 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.20%	47'263.97	0.00	a)
DE000CZ43ZX7	3.1250 % CMZB 3 1/8 04/20/29 EMTN	0	60	0	60 EUR	100.13%	57'245.04	0.01	a)
DE000CZ45W16	0.5000 % CMZB 0 1/2 03/15/27 EMTN	60	0	0	60 EUR	92.36%	52'803.27	0.01	a)
DE000CZ45W99	2.2500 % CMZB 2 1/4 09/01/32 EMTN	0	70	0	70 EUR	94.02%	62'713.07	0.01	a)
DE000CZ45WY7	0.2500 % CMZB 0 1/4 01/12/32 EMTN	30	0	0	30 EUR	80.59%	23'038.15	0.00	a)
DE000DHY4861	0.3750 % NDB 0 3/8 06/20/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.98%	91'454.89	0.01	a)
DE000DL19S01	0.5000 % DB 0 1/2 06/09/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	93.99%	44'782.18	0.00	a)
DE000DL19SH3	0.2500 % DB 0 1/4 03/08/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19U31	0.1250 % DB 0 1/8 01/21/30	80	0	0	80 EUR	84.42%	64'356.98	0.01	a)
DE000GRN0024	0.0100 % DKRED 0.01 02/23/26	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0BH9	0.0100 % HCOB 0.01 01/19/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.48%	86'219.75	0.01	a)
DE000HV2ASK2	0.8500 % HVB 0.85 05/22/34 EMTN	60	0	0	60 EUR	80.56%	46'056.86	0.00	a)
DE000HV2AST3	0.0100 % HVB 0.01 09/10/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HV2ATM6	0.0100 % HVB 0.01 09/15/28 EMTN	60	0	0	60 EUR	87.11%	49'801.12	0.01	a)
DE000HV2AY79	2.7500 % HVB 2 3/4 02/27/26	0	100	0	100 EUR	98.85%	94'193.47	0.01	a)
DE000HV2AYD5	0.0100 % HVB 0.01 03/10/31 EMTN	50	0	0	50 EUR	81.12%	38'650.38	0.00	a)
DE000HV2AYU9	0.5000 % HVB 0 1/2 02/23/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.34%	87'990.20	0.01	a)
DE000LB125N3	0.3750 % LBBW 0 3/8 01/14/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	94.67%	45'105.21	0.00	a)
DE000LB1DSM2	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/27/25 EMTN	0	70	0	70 EUR	96.83%	64'587.39	0.01	a)
DE000LB2CW16	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/21/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.69%	72'119.93	0.01	a)
DE000LB2ZV93	1.7500 % LBBW 1 3/4 02/28/28 829	50	0	0	50 EUR	95.14%	45'329.62	0.00	a)
DE000LB386A8	3.2500 % LBBW 3 1/4 11/04/26	0	70	0	70 EUR	100.20%	66'836.57	0.01	a)
DE000MHB13J7	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 03/14/25 EMTN	40	0	0	40 EUR	96.80%	36'897.17	0.00	a)
DE000MHB18J6	0.6250 % MUNHYP 0 5/8 05/07/27 EMTN	80	0	0	80 EUR	92.53%	70'533.95	0.01	a)
DE000MHB27J7	0.0100 % MUNHYP 0.01 10/19/39 1914	30	0	0	30 EUR	61.25%	17'510.38	0.00	a)
DE000MHB29J3	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 02/01/29 EMTN	70	0	0	70 EUR	86.94%	57'989.91	0.01	a)
DE000MHB31J9	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 08/25/32 EMTN	0	60	0	60 EUR	91.59%	52'364.75	0.01	a)
DE000NLB2TD7	0.7500 % NDB 0 3/4 01/18/28 EMTN	0	60	0	60 EUR	91.44%	52'278.42	0.01	a)
DE000NLB8739	0.6250 % NDB 0 5/8 01/18/27 EMTN	50	0	0	50 EUR	92.95%	44'282.87	0.00	a)
DE000NRW0K03	0.9500 % NRW 0.95 03/13/28 EMTN	70	0	0	70 EUR	92.68%	61'816.59	0.01	a)
DE000NRW0K52	1.5000 % NRW 1 1/2 06/12/40 EMTN	60	50	0	110 EUR	79.43%	83'251.04	0.01	a)
DE000NRW0KE7	1.6500 % NRW 1.65 05/16/47 EMTN	70	0	0	70 EUR	75.32%	50'237.82	0.01	a)
DE000NRW0KF4	1.5500 % NRW 1.55 06/16/48 1439	50	50	0	100 EUR	72.91%	69'477.59	0.01	a)
DE000NRW0KZ2	1.6500 % NRW 1.65 02/22/38 EMTN	50	0	0	50 EUR	83.92%	39'982.99	0.00	a)
DE000NRW0L10	1.3750 % NRW 1 3/8 01/15/2120 EMTN	60	0	0	60 EUR	51.46%	29'422.94	0.00	a)
DE000NRW0L85	0.2000 % NRW 0.2 03/31/27	70	0	0	70 EUR	91.92%	61'309.66	0.01	a)
DE000NRW0L93	0.0000 % NRW 0 04/02/24	70	0	0	70 EUR	99.69%	66'497.73	0.01	a)
DE000NRW0LC9	1.9500 % NRW 1.95 09/26/2078 EMTN	50	0	0	50 EUR	70.94%	33'800.68	0.00	a)
DE000NRW0LN6	0.2500 % NRW 0 1/4 03/13/26 EMTN	80	0	0	80 EUR	94.37%	71'935.83	0.01	a)
DE000NRW0LQ9	2.1500 % NRW 2.15 03/21/2119 EMTN	0	40	0	40 EUR	72.29%	27'554.34	0.00	a)
DE000NRW0M35	0.5000 % NRW 0 1/2 01/15/52 EMTN	60	0	0	60 EUR	51.01%	29'165.09	0.00	a)
DE000NRW0M92	1.4500 % NRW 1.45 01/19/2122 EMTN	0	70	0	70 EUR	52.15%	34'786.34	0.00	a)
DE000NRW0MA1	0.2000 % NRW 0.2 04/09/30	70	0	0	70 EUR	85.52%	57'040.74	0.01	a)
DE000NRW0ME3	0.0000 % NRW 0 05/05/25	90	0	0	90 EUR	96.10%	82'417.46	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000NRW0MJ2	0.3750 % NRW 0 3/8 09/02/50 EMTN	60	0	0	60 EUR	50.24%	28'726.00	0.00	a)
DE000NRW0MK0	0.0000 % NRW 0 01/15/29	40	0	0	40 EUR	87.10%	33'199.98	0.00	a)
DE000NRW0ML8	0.0000 % NRW 0 10/12/35 15YR	80	0	0	80 EUR	71.00%	54'123.78	0.01	a)
DE000NRW0MP9	0.9500 % NRW 0.95 01/10/2121 EMTN	60	0	0	60 EUR	43.88%	25'088.09	0.00	a)
DE000NRW0MY1	0.1250 % NRW 0 1/8 06/04/31 EMTN	70	0	0	70 EUR	82.51%	55'037.69	0.01	a)
DE000NRW0N26	3.4000 % NRW 3.4 03/07/2073 EMTN	0	70	0	70 EUR	106.81%	71'244.23	0.01	a)
DE000NRW0N67	2.9000 % NRW 2.9 06/07/33 EMTN	0	70	0	70 EUR	100.25%	66'869.26	0.01	a)
DE000NRW0N83	3.3750 % NRW 3 3/8 10/31/28 EMTN	0	40	0	40 EUR	102.19%	38'950.44	0.00	a)
DE000NRW0NF8	2.0000 % NRW 2 06/15/32 EMTN	60	0	0	60 EUR	93.79%	53'622.56	0.01	a)
DE000NRW0NG6	2.2500 % NRW 2 1/4 06/14/52 EMTN	50	0	0	50 EUR	82.84%	39'467.95	0.00	a)
DE000NRW0NW3	2.7500 % NRW 2 3/4 01/15/32 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.33%	47'322.57	0.00	a)
DE000NRW0NX1	2.9000 % NRW 2.9 01/15/53 EMTN	60	0	0	60 EUR	94.24%	53'879.84	0.01	a)
DE000NWB0AP2	0.0000 % NRW BK 0 09/22/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.74%	83'609.80	0.01	a)
DE000NWB0AS6	2.5000 % NRW BK 2 1/2 09/07/37	0	100	0	100 EUR	93.04%	88'655.32	0.01	a)
DE000NWB0AU2	3.0000 % NRW BK 3 05/31/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.83%	96'077.33	0.01	a)
DE000NWB18E4	0.2500 % NRW BK 0 1/4 07/04/25	0	100	0	100 EUR	95.89%	91'373.89	0.01	a)
DE000NWB9080	0.2500 % NRW BK 0 1/4 03/16/27	0	100	0	100 EUR	92.11%	87'773.90	0.01	a)
DE000RLP0835	0.3750 % RHIPAL 0 3/8 01/26/27	0	60	0	60 EUR	92.72%	53'011.95	0.01	a)
DE000RLP1254	0.0100 % RHIPAL 0.01 01/21/31	40	0	0	40 EUR	82.62%	31'490.13	0.00	a)
DE000RLP1270	0.3750 % RHIPAL 0 3/8 03/10/51	35	0	0	35 EUR	49.81%	16'611.43	0.00	a)
DE000RLP1361	0.0100 % RHIPAL 0.01 03/17/25 EMTN	70	0	0	70 EUR	96.47%	64'344.59	0.01	a)
DE000RLP1395	3.0000 % RHIPAL 3 01/15/25 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.45%	47'380.70	0.00	a)
DE000SCB0047	3.0000 % DKRED 3 01/31/35	0	60	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000SHFM725	0.0100 % SCHHOL 0.01 04/02/24	50	0	0	50 EUR	99.69%	47'498.38	0.00	a)
DE000SHFM808	0.0500 % SCHHOL 0.05 07/08/31	80	0	0	80 EUR	81.66%	62'246.15	0.01	a)
DE000SHFM840	1.3750 % SCHHOL 1 3/8 07/14/27	80	0	0	80 EUR	95.00%	72'416.85	0.01	a)
DE000SHFM907	3.0000 % SCHHOL 3 08/16/33	0	50	0	50 EUR	101.23%	48'228.76	0.00	a)
DK0009412553	3.2500 % JYKRE 3 1/4 07/01/30	0	100	0	100 EUR	100.67%	95'926.77	0.01	a)
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	401	70	0	471 EUR	113.94%	511'389.87	0.05	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	345	0	0	345 EUR	115.33%	379'128.19	0.04	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	151	0	151	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	333	40	0	373 EUR	113.42%	403'134.27	0.04	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	250	0	0	250 EUR	101.88%	242'689.87	0.02	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	400	100	0	500 EUR	106.48%	507'300.82	0.05	a)
ES00000123X3	4.4000 % SPGB 4.4 10/31/23	133	0	133	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	270	170	0	440 EUR	119.44%	500'753.56	0.05	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	195	150	0	345 EUR	109.54%	360'120.17	0.04	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	243	50	0	293 EUR	120.44%	336'256.67	0.03	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	204	0	204	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	182	90	0	272 EUR	98.03%	254'078.35	0.03	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	380	40	0	420 EUR	93.97%	376'094.30	0.04	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	425	0	0	425 EUR	98.45%	398'710.47	0.04	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	405	0	0	405 EUR	97.70%	377'053.24	0.04	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	329	70	50	349 EUR	87.29%	290'271.77	0.03	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	228	40	0	268 EUR	90.69%	231'587.33	0.02	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	278	220	0	498 EUR	95.73%	454'259.00	0.05	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	278	170	0	448 EUR	95.64%	408'270.74	0.04	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	187	160	0	347 EUR	93.16%	308'037.34	0.03	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	238	150	0	388 EUR	107.83%	398'656.64	0.04	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	253	180	0	433 EUR	94.90%	391'539.48	0.04	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	284	200	0	484 EUR	94.07%	433'832.82	0.04	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	190	150	0	340 EUR	83.05%	269'055.96	0.03	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	399	100	0	499 EUR	93.77%	445'861.10	0.05	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	214	190	0	404 EUR	93.00%	358'017.34	0.04	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	391	0	0	391 EUR	85.88%	319'954.57	0.03	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	152	0	152	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	301	130	0	431 EUR	87.83%	360'723.75	0.04	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	280	240	0	520 EUR	86.20%	427'115.49	0.04	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	400	0	0	400 EUR	96.90%	369'345.22	0.04	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	332	60	0	392 EUR	54.02%	201'796.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	367	40	0	407 EUR	93.11%	361'086.98	0.04	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	428	0	0	428 EUR	89.42%	364'697.48	0.04	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	223	220	70	373 EUR	69.67%	247'635.61	0.03	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	214	150	0	364 EUR	94.32%	327'145.03	0.03	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	178	0	178	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	285	170	0	455 EUR	81.33%	352'615.92	0.04	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	52	80	0	132 EUR	48.72%	61'280.31	0.01	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	379	120	0	499 EUR	89.29%	424'573.47	0.04	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	130	140	0	270 EUR	71.84%	184'834.03	0.02	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	206	230	0	436 EUR	82.62%	343'259.01	0.04	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	67	165	0	232 EUR	64.72%	143'073.61	0.01	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	378	50	0	428 EUR	91.76%	374'232.64	0.04	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	413	0	0	413 EUR	82.84%	325'997.42	0.03	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	364	0	0	364 EUR	95.98%	332'902.73	0.03	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	124	230	0	354 EUR	66.92%	225'735.02	0.02	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	310	170	0	480 EUR	89.30%	408'448.51	0.04	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	375	30	0	405 EUR	95.51%	368'590.06	0.04	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	60	190	50	200 EUR	95.99%	182'930.74	0.02	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	0	390	0	390 EUR	99.41%	369'443.08	0.04	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	229	180	0	409 EUR	99.62%	388'240.54	0.04	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	250	0	250 EUR	103.16%	245'758.15	0.03	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	0	500	40	460 EUR	102.53%	449'416.01	0.05	a)
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	0	120	0	120 EUR	102.57%	117'280.12	0.01	a)
ES0000012M85	3.2500 % SPGB 3 1/4 04/30/34	0	190	0	190 EUR	99.68%	180'466.68	0.02	a)
ES0000090797	1.8750 % ANDAL 1 7/8 10/31/28	0	40	0	40 EUR	94.08%	35'857.76	0.00	a)
ES0000090847	0.5000 % ANDAL 0 1/2 04/30/31	50	0	0	50 EUR	81.75%	38'950.54	0.00	a)
ES00001010B7	0.4200 % MADRID 0.42 04/30/31	30	0	0	30 EUR	81.74%	23'365.46	0.00	a)
ES00001010I2	1.7230 % MADRID 1.723 04/30/32	30	0	0	30 EUR	88.27%	25'234.16	0.00	a)
ES00001010K8	3.5960 % MADRID 3.596 04/30/33	0	40	0	40 EUR	101.52%	38'696.21	0.00	a)
ES0000101263	4.3000 % MADRID 4.3 09/15/26	0	40	0	40 EUR	102.33%	39'002.66	0.00	a)
ES0000101602	4.1250 % MADRID 4 1/8 05/21/24	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000101651	1.8260 % MADRID 1.826 04/30/25	40	0	0	40 EUR	97.94%	37'331.30	0.00	a)
ES0000101909	1.5710 % MADRID 1.571 04/30/29	40	0	0	40 EUR	92.43%	35'228.86	0.00	a)
ES0000101966	0.8270 % MADRID 0.827 07/30/27	60	0	0	60 EUR	92.45%	52'854.73	0.01	a)
ES0000106635	1.1250 % BASQUE 1 1/8 04/30/29	0	50	0	50 EUR	90.52%	43'126.07	0.00	a)
ES0000106684	0.2500 % BASQUE 0 1/4 04/30/31	50	0	0	50 EUR	81.27%	38'718.99	0.00	a)
ES0001352626	3.7110 % JUNGAL 3.711 07/30/29	0	50	0	50 EUR	102.22%	48'702.35	0.00	a)
ES0200002030	1.2500 % ADIFAL 1 1/4 05/04/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0312342019	3.7500 % AYTCD 3 3/4 06/30/25 X	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0371622020	4.2500 % CEDTDA 4 1/4 04/10/31 A6	100	100	100	100 EUR	106.47%	101'457.31	0.01	a)
ES0378641346	0.0500 % FADE 0.05 09/17/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0413211A75	3.1250 % BBVASM 3 1/8 07/17/27	0	100	0	100 EUR	99.54%	94'845.25	0.01	a)
ES0413679525	3.0500 % BKTSM 3.05 05/29/28	0	100	0	100 EUR	98.73%	94'078.18	0.01	a)
ES0413860547	0.6250 % SABSM 0 5/8 06/10/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0413860802	1.7500 % SABSM 1 3/4 05/30/29	0	100	0	100 EUR	92.28%	87'930.17	0.01	a)
ES0413900129	3.8750 % SANTAN 3 7/8 02/06/26 12	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0413900574	0.1250 % SANTAN 0 1/8 06/04/30	100	0	0	100 EUR	82.24%	78'367.99	0.01	a)
ES0413900848	2.3750 % SANTAN 2 3/8 09/08/27	0	100	0	100 EUR	97.06%	92'484.96	0.01	a)
ES0413900855	2.7500 % SANTAN 2 3/4 09/08/32	100	0	0	100 EUR	95.97%	91'447.27	0.01	a)
ES0413900905	3.3750 % SANTAN 3 3/8 01/11/26	0	100	0	100 EUR	99.77%	95'071.08	0.01	a)
ES0414950644	4.1250 % CABKSM 4 1/8 03/24/36	50	0	0	50 EUR	107.13%	51'042.15	0.01	a)
ES0414970204	3.8750 % CABKSM 3 7/8 02/17/25	100	0	0	100 EUR	99.98%	95'272.14	0.01	a)
ES0440609339	1.2500 % CABKSM 1 1/4 01/11/27	0	100	0	100 EUR	94.21%	89'771.14	0.01	a)
EU000A19VVY6	0.5000 % EU 0 1/2 04/04/25 EMTN	60	0	0	60 EUR	97.05%	55'484.68	0.01	a)
EU000A1G0AJ7	3.8750 % EFSF 3 7/8 03/30/32 EMTN	60	0	0	60 EUR	107.20%	61'288.32	0.01	a)
EU000A1G0AT6	3.3750 % EFSF 3 3/8 04/03/37 EMTN	40	0	0	40 EUR	103.01%	39'262.23	0.00	a)
EU000A1G0BJ5	3.0000 % EFSF 3 09/04/34 21Y	40	0	0	40 EUR	100.22%	38'197.28	0.00	a)
EU000A1G0D05	1.4500 % EFSF 1.45 09/05/40 EMTN	40	50	0	90 EUR	78.35%	67'190.86	0.01	a)
EU000A1G0D62	0.4000 % EFSF 0.4 02/17/25 EMTN	60	0	0	60 EUR	97.12%	55'523.56	0.01	a)
EU000A1G0D70	0.9500 % EFSF 0.95 02/14/28 EMTN	60	40	0	100 EUR	92.84%	88'466.65	0.01	a)
EU000A1G0D88	0.6250 % EFSF 0 5/8 10/16/26 EMTN	30	70	0	100 EUR	94.13%	89'695.87	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EU000A1G0D96	1.7500 % EFSF 1 3/4 07/17/53	30	20	0	50 EUR	72.89%	34'727.83	0.00	a)
EU000A1G0DB8	2.3500 % EFSF 2.35 07/29/44 EMTN	50	40	0	90 EUR	88.01%	75'478.65	0.01	a)
EU000A1G0DD4	1.2000 % EFSF 1.2 02/17/45 EMTN	60	0	0	60 EUR	70.65%	40'392.73	0.00	a)
EU000A1G0DE2	0.2000 % EFSF 0.2 04/28/25 0000	30	0	0	30 EUR	96.44%	27'567.68	0.00	a)
EU000A1G0DH5	0.4000 % EFSF 0.4 05/31/26 EMTN	50	40	0	90 EUR	94.43%	80'986.13	0.01	a)
EU000A1G0DJ1	1.3750 % EFSF 1 3/8 05/31/47 EMTN	60	60	0	120 EUR	71.55%	81'811.14	0.01	a)
EU000A1G0DL7	1.7000 % EFSF 1.7 02/13/43 EMTN	90	0	0	90 EUR	79.55%	68'224.26	0.01	a)
EU000A1G0DN3	2.0000 % EFSF 2 02/28/56 EMTN	50	0	0	50 EUR	76.71%	36'548.32	0.00	a)
EU000A1G0DQ6	0.3750 % EFSF 0 3/8 10/11/24 EMTN	50	0	0	50 EUR	98.10%	46'737.50	0.00	a)
EU000A1G0DR4	0.7500 % EFSF 0 3/4 05/03/27 EMTN	90	0	0	90 EUR	93.64%	80'305.20	0.01	a)
EU000A1G0DTP	1.2500 % EFSF 1 1/4 05/24/33 EMTN	50	60	0	110 EUR	86.76%	90'940.43	0.01	a)
EU000A1G0DV6	0.5000 % EFSF 0 1/2 07/11/25 EMTN	80	0	0	80 EUR	96.38%	73'470.36	0.01	a)
EU000A1G0DW4	1.8000 % EFSF 1.8 07/10/48 EMTN	50	40	0	90 EUR	76.85%	65'903.61	0.01	a)
EU000A1G0DY0	0.8750 % EFSF 0 7/8 07/26/27 EMTN	30	40	0	70 EUR	93.62%	62'445.59	0.01	a)
EU000A1G0EA8	0.2000 % EFSF 0.2 01/17/24 EMTN	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G0EB6	0.4000 % EFSF 0.4 01/26/26	90	0	0	90 EUR	95.10%	81'558.15	0.01	a)
EU000A1G0EC4	0.0000 % EFSF 0 04/19/24	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1G0ED2	0.8750 % EFSF 0 7/8 04/10/35 EMTN	40	50	0	90 EUR	80.07%	68'670.21	0.01	a)
EU000A1G0EE0	0.0500 % EFSF 0.05 10/17/29	50	60	0	110 EUR	85.62%	89'746.56	0.01	a)
EU000A1G0EG5	0.7000 % EFSF 0.7 01/20/50	40	0	0	40 EUR	57.33%	21'850.76	0.00	a)
EU000A1G0EJ9	0.0000 % EFSF 0 10/15/25	50	40	0	90 EUR	95.06%	81'521.27	0.01	a)
EU000A1G0EK7	0.0000 % EFSF 0 10/13/27	80	0	0	80 EUR	90.17%	68'735.67	0.01	a)
EU000A1G0EL5	0.0000 % EFSF 0 01/20/31	65	0	0	65 EUR	82.33%	50'990.60	0.01	a)
EU000A1G0EM3	0.0500 % EFSF 0.05 01/18/52	60	0	0	60 EUR	43.04%	24'606.12	0.00	a)
EU000A1G0EN1	0.0000 % EFSF 0 07/20/26	50	40	0	90 EUR	93.15%	79'883.26	0.01	a)
EU000A1G0EP6	0.1250 % EFSF 0 1/8 03/18/30	50	0	0	50 EUR	85.12%	40'556.62	0.00	a)
EU000A1G6TV9	2.8750 % EU 2 7/8 04/04/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.17%	95'450.33	0.01	a)
EU000A1U9894	1.0000 % ESM 1 09/23/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.67%	92'114.28	0.01	a)
EU000A1U9928	1.6250 % ESM 1 5/8 11/17/36 EMTN	60	0	0	60 EUR	85.24%	48'735.98	0.00	a)
EU000A1U9944	0.5000 % ESM 0 1/2 03/02/26 EMTN	60	60	0	120 EUR	95.12%	108'765.92	0.01	a)
EU000A1U9951	0.1250 % ESM 0 1/8 04/22/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1U9969	1.1250 % ESM 1 1/8 05/03/32 EMTN	40	40	0	80 EUR	87.62%	66'791.79	0.01	a)
EU000A1U9977	0.8750 % ESM 0 7/8 07/18/42 EMTN	0	70	0	70 EUR	67.81%	45'231.18	0.00	a)
EU000A1Z6630	0.6250 % EU 0 5/8 11/04/23 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1Z99A1	1.8000 % ESM 1.8 11/02/46 EMTN	120	50	0	170 EUR	78.89%	127'800.53	0.01	a)
EU000A1Z99B9	0.7500 % ESM 0 3/4 03/15/27 EMTN	30	50	0	80 EUR	93.80%	71'502.84	0.01	a)
EU000A1Z99F0	0.7500 % ESM 0 3/4 09/05/28 EUR	70	0	0	70 EUR	91.23%	60'851.42	0.01	a)
EU000A1Z99H6	0.5000 % ESM 0 1/2 03/05/29 EMTN	70	0	0	70 EUR	89.28%	59'552.07	0.01	a)
EU000A1Z99J2	0.0000 % ESM 0 03/14/25	10	40	0	50 EUR	96.58%	46'015.21	0.00	a)
EU000A1Z99M6	0.0000 % ESM 0 12/16/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A1Z99N4	0.0000 % ESM 0 12/15/26	50	0	0	50 EUR	92.20%	43'927.45	0.00	a)
EU000A1Z99P9	0.0100 % ESM 0.01 10/15/31	50	0	0	50 EUR	81.01%	38'594.16	0.00	a)
EU000A1Z99Q7	1.0000 % ESM 1 06/23/27	50	0	0	50 EUR	94.03%	44'801.24	0.00	a)
EU000A1Z99R5	3.0000 % ESM 3 03/15/28 ESM	0	60	0	60 EUR	100.53%	57'477.73	0.01	a)
EU000A1Z99S3	3.0000 % ESM 3 08/23/33	0	50	0	50 EUR	101.06%	48'146.81	0.00	a)
EU000A283859	0.0000 % EU 0 10/04/30 SURE	180	0	0	180 EUR	83.48%	143'175.49	0.01	a)
EU000A283867	0.1000 % EU 0.1 10/04/40 SURE	75	80	0	155 EUR	61.40%	90'682.96	0.01	a)
EU000A284451	0.0000 % EU 0 11/04/25 SURE	130	0	0	130 EUR	94.95%	117'617.92	0.01	a)
EU000A284469	0.3000 % EU 0.3 11/04/50 SURE	70	100	0	170 EUR	49.80%	80'667.87	0.01	a)
EU000A285VM2	0.0000 % EU 0 07/04/35 SURE	200	0	0	200 EUR	71.55%	136'357.61	0.01	a)
EU000A287074	0.0000 % EU 0 06/02/28 SURE	180	60	0	240 EUR	88.92%	203'346.08	0.02	a)
EU000A2SCAA6	0.7000 % EFSF 0.7 01/17/53	35	0	0	35 EUR	53.90%	17'974.81	0.00	a)
EU000A2SCAB4	0.8750 % EFSF 0 7/8 09/05/28	50	0	0	50 EUR	91.64%	43'661.12	0.00	a)
EU000A2SCAC2	2.3750 % EFSF 2 3/8 06/21/32	40	0	0	40 EUR	96.15%	36'647.51	0.00	a)
EU000A2SCAD0	1.5000 % EFSF 1 1/2 12/15/25 EMTN	60	0	0	60 EUR	97.18%	55'561.30	0.01	a)
EU000A2SCAE8	2.3750 % EFSF 2 3/8 04/11/28 EMTN	70	0	0	70 EUR	98.00%	65'368.47	0.01	a)
EU000A2SCAF5	2.7500 % EFSF 2 3/4 08/17/26	60	0	0	60 EUR	99.32%	56'783.08	0.01	a)
EU000A2SCAG3	2.8750 % EFSF 2 7/8 02/16/33 EMTN	90	0	0	90 EUR	99.75%	85'542.53	0.01	a)
EU000A2SCAH1	3.0000 % EFSF 3 12/15/28	0	70	0	70 EUR	100.52%	67'045.35	0.01	a)
EU000A2SCAJ7	3.0000 % EFSF 3 07/10/30 EFSF	0	70	0	70 EUR	100.75%	67'203.43	0.01	a)
EU000A2SCAK5	3.3750 % EFSF 3 3/8 08/30/38 EMTN	0	50	0	50 EUR	102.00%	48'595.62	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EU000A2SCAL3	3.5000 % EFSF 3 1/2 04/11/29	0	50	0	50 EUR	102.89%	49'022.51	0.01	a)
EU000A2SCAM1	2.6250 % EFSF 2 5/8 07/16/29 EMTN	0	80	0	80 EUR	98.81%	75'319.71	0.01	a)
EU000A3K4C42	0.4000 % EU 0.4 02/04/37 NGEU	275	0	0	275 EUR	71.88%	188'359.08	0.02	a)
EU000A3K4D09	2.7500 % EU 2 3/4 12/04/37 SURE	120	0	0	120 EUR	96.03%	109'800.75	0.01	a)
EU000A3K4D41	3.2500 % EU 3 1/4 07/04/34 NGEU	0	230	0	230 EUR	102.30%	224'195.16	0.02	a)
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	0	220	0	220 EUR	101.61%	213'005.26	0.02	a)
EU000A3K4D82	2.7500 % EU 2 3/4 10/05/26 NGEU	0	200	0	200 EUR	99.38%	189'398.91	0.02	a)
EU000A3K4DA4	0.2500 % EU 0 1/4 10/22/26 EMTN	80	0	0	80 EUR	93.35%	71'157.52	0.01	a)
EU000A3K4DD8	1.0000 % EU 1 07/06/32 NGEU	270	100	0	370 EUR	86.14%	303'686.98	0.03	a)
EU000A3K4DE6	1.1250 % EU 1 1/8 06/04/37 SURE	50	0	0	50 EUR	78.77%	37'528.36	0.00	a)
EU000A3K4DG1	1.2500 % EU 1 1/4 02/04/43 NGEU	90	0	0	90 EUR	71.78%	61'559.03	0.01	a)
EU000A3K4DJ5	0.8000 % EU 0.8 07/04/25 NGEU	160	120	0	280 EUR	96.73%	258'080.08	0.03	a)
EU000A3K4DM9	2.6250 % EU 2 5/8 02/04/48 NGEU	70	170	0	240 EUR	89.18%	203'945.25	0.02	a)
EU000A3K4DS6	2.0000 % EU 2 10/04/27 NGEU	170	110	0	280 EUR	97.01%	258'835.14	0.03	a)
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	70	90	0	160 EUR	84.66%	129'078.34	0.01	a)
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	140	130	0	270 EUR	100.75%	259'205.53	0.03	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	60	110	0	170 EUR	98.83%	160'091.65	0.02	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	110	190	0	300 EUR	93.52%	267'326.67	0.03	a)
EU000A3K4ED6	3.0000 % EIB 3 11/15/28 EARN	0	50	0	50 EUR	100.70%	47'976.73	0.00	a)
EU000A3K4EL9	4.0000 % EU 4 04/04/44 NGEU	0	70	0	70 EUR	109.19%	72'831.07	0.01	a)
EU000A3K4EN5	3.1250 % EU 3 1/8 12/05/28 NGEU	0	80	0	80 EUR	101.07%	77'042.53	0.01	a)
EU000A3K7MW2	1.6250 % EU 1 5/8 12/04/29 NGEU	190	150	0	340 EUR	93.58%	303'167.85	0.03	a)
EU000A3KM903	0.2000 % EU 0.2 06/04/36 SURE	80	90	0	170 EUR	71.39%	115'644.79	0.01	a)
EU000A3KNYF7	0.0000 % EU 0 03/04/26 SURE	80	60	0	140 EUR	94.11%	125'546.20	0.01	a)
EU000A3KNYG5	0.4500 % EU 0.45 05/02/46 SURE	110	0	0	110 EUR	57.48%	60'249.96	0.01	a)
EU000A3KP2Z3	0.2500 % EU 0 1/4 04/22/36 EMTN	140	0	0	140 EUR	72.07%	96'138.69	0.01	a)
EU000A3KRJQ6	0.0000 % EU 0 07/04/29 SURE	150	0	0	150 EUR	86.33%	123'396.49	0.01	a)
EU000A3KRJR4	0.7500 % EU 0 3/4 01/04/47 SURE	50	60	0	110 EUR	61.61%	64'575.76	0.01	a)
EU000A3KSXE1	0.0000 % EU 0 07/04/31 NGEU	290	100	0	390 EUR	81.33%	302'227.36	0.03	a)
EU000A3KT6A3	0.0000 % EU 0 04/22/31 EMTN	90	40	0	130 EUR	82.00%	101'579.85	0.01	a)
EU000A3KT6B1	0.4500 % EU 0.45 07/04/41 NGEU	230	80	0	310 EUR	62.77%	185'430.53	0.02	a)
EU000A3KTGV8	0.0000 % EU 0 07/06/26 NGEU	280	40	0	320 EUR	93.31%	284'517.26	0.03	a)
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	160	100	0	260 EUR	54.54%	135'117.72	0.01	a)
EU000A3KWCF4	0.0000 % EU 0 10/04/28 NGEU	180	110	0	290 EUR	87.90%	242'902.27	0.02	a)
EU000A3LNF05	3.1250 % EU 3 1/8 12/04/30 NGEU	0	180	0	180 EUR	101.59%	174'241.02	0.02	a)
EU000A3LS460	2.7500 % EIB 2 3/4 01/16/34 EARN	0	100	0	100 EUR	98.56%	93'913.33	0.01	a)
EU000A3LT492	3.0000 % EIB 3 02/15/39	0	60	0	60 EUR	98.37%	56'239.94	0.01	a)
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25	58	20	0	78 EUR	100.98%	75'049.57	0.01	a)
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	98	0	0	98 EUR	100.02%	93'402.18	0.01	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	61	35	0	96 EUR	93.63%	85'647.90	0.01	a)
FI4000062625	1.5000 % RFGB 1 1/2 04/15/23	17	0	17	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	59	0	59	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	52	40	0	92 EUR	87.09%	76'344.18	0.01	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	67	20	0	87 EUR	96.71%	80'170.10	0.01	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	83	30	0	113 EUR	95.09%	102'383.56	0.01	a)
FI4000219787	0.0000 % RFGB 0 09/15/23	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	87	25	0	112 EUR	72.72%	77'609.99	0.01	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	73	40	0	113 EUR	92.41%	99'507.53	0.01	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	65	50	0	115 EUR	84.67%	92'783.83	0.01	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	62	100	0	162 EUR	90.57%	139'816.46	0.01	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	121	0	0	121 EUR	88.59%	102'140.98	0.01	a)
FI4000391529	0.0000 % RFGB 0 09/15/24	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	24	50	0	74 EUR	71.02%	50'080.71	0.01	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	53	0	0	53 EUR	63.70%	32'170.30	0.00	a)
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30	59	50	0	109 EUR	83.75%	86'987.38	0.01	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	53	50	0	103 EUR	46.55%	45'686.44	0.00	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	118	0	0	118 EUR	82.11%	92'322.43	0.01	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26	44	40	0	84 EUR	93.02%	74'451.26	0.01	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43	70	0	0	70 EUR	62.95%	41'988.81	0.00	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32	60	40	0	100 EUR	90.06%	85'814.77	0.01	a)
FI4000527551	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/27	70	0	0	70 EUR	95.73%	63'855.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38	80	0	0	80 EUR	96.29%	73'402.51	0.01	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33	0	120	0	120 EUR	101.11%	115'612.96	0.01	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	50	0	50 EUR	100.54%	47'903.35	0.00	a)
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	532	100	0	632 EUR	122.03%	734'861.76	0.08	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	312	210	0	522 EUR	104.56%	520'071.88	0.05	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	548	140	0	688 EUR	113.05%	741'124.34	0.08	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	302	190	0	492 EUR	116.79%	547'533.27	0.06	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	346	0	0	346 EUR	112.88%	372'169.30	0.04	a)
FR0010292169	3.8750 % CFF 3 7/8 04/25/55 EMTN	30	0	0	30 EUR	113.34%	32'401.08	0.00	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	383	190	80	493 EUR	110.48%	518'989.47	0.05	a)
FR0010466938	4.2500 % FRTR 4 1/4 10/25/23	318	0	318	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	578	160	30	708 EUR	117.45%	792'332.63	0.08	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	164	245	0	409 EUR	114.38%	445'772.38	0.05	a)
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	50	0	0	50 EUR	105.02%	50'035.43	0.01	a)
FR0010913749	4.0000 % CFF 4 10/24/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.88%	48'062.01	0.00	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	585	220	0	805 EUR	101.16%	775'984.49	0.08	a)
FR0010961540	4.0000 % EDF 4 11/12/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	101.06%	48'149.67	0.00	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	717	370	90	997 EUR	99.92%	949'274.21	0.10	a)
FR0011388339	2.4000 % CRH 2.4 01/17/25 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011439785	2.6250 % SAGESSE 2 5/8 03/06/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	526	0	0	526 EUR	100.09%	501'647.70	0.05	a)
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	313	0	313	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011755156	2.3750 % UNEDIC 2 3/8 05/25/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	799	330	0	1'129 EUR	98.81%	1'062'949.46	0.11	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	355	0	355	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012159812	1.3750 % CADES 1 3/8 11/25/24 EMTN	80	0	0	80 EUR	98.22%	74'870.72	0.01	a)
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	748	110	0	858 EUR	96.69%	790'544.95	0.08	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	383	350	0	733 EUR	96.57%	674'478.28	0.07	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	781	370	80	1'071 EUR	92.04%	939'303.27	0.10	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	707	240	60	887 EUR	94.89%	801'983.64	0.08	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	309	0	0	309 EUR	67.68%	199'280.59	0.02	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	795	40	0	835 EUR	82.09%	653'123.52	0.07	a)
FR0013183167	0.5000 % IDF 0 1/2 06/14/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.06%	91'535.88	0.01	a)
FR0013190188	0.2500 % AGFRNC 0 1/4 07/21/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.11%	88'722.02	0.01	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	615	120	0	735 EUR	93.30%	653'444.54	0.07	a)
FR0013220902	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 04/30/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013230703	0.7500 % CAFFIL 0 3/4 01/11/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.27%	88'879.24	0.01	a)
FR0013232253	0.8750 % BPIFRA 0 7/8 11/25/26	100	0	0	100 EUR	93.97%	89'542.45	0.01	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	419	140	0	559 EUR	83.76%	446'162.86	0.05	a)
FR0013246873	1.2500 % UNEDIC 1 1/4 03/28/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.65%	90'193.27	0.01	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	632	120	0	752 EUR	94.55%	677'529.66	0.07	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	291	320	0	611 EUR	79.03%	460'139.41	0.05	a)
FR0013264439	2.1250 % CTEFRA 2 1/8 07/29/32	100	0	0	100 EUR	88.71%	84'531.24	0.01	a)
FR0013281748	0.3750 % CFF 0 3/8 12/11/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013284908	0.7500 % CMARK 0 3/4 10/05/27	50	0	0	50 EUR	91.83%	43'749.73	0.00	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	791	360	60	1'091 EUR	92.21%	958'632.05	0.10	a)
FR0013310059	0.5000 % ACACB 0 1/2 02/19/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.75%	90'286.65	0.01	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	436	420	0	856 EUR	85.50%	697'420.76	0.07	a)
FR0013314036	0.7500 % SFILFR 0 3/4 02/06/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.15%	90'662.09	0.01	a)
FR0013330693	1.0000 % CAFFIL 1 04/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.61%	87'293.65	0.01	a)
FR0013336492	1.2500 % UNEDIC 1 1/4 05/25/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.38%	82'308.16	0.01	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	754	330	0	1'084 EUR	91.39%	944'021.68	0.10	a)
FR0013343340	1.1250 % AFLBNK 1 1/8 06/20/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.77%	87'448.97	0.01	a)
FR0013344181	0.1250 % CADES 0 1/8 10/25/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	379	0	379	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013369758	0.8750 % UNEDIC 0 7/8 05/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.76%	87'434.67	0.01	a)
FR0013383585	0.5000 % SOCSFH 0 1/2 01/30/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013399169	0.5000 % LBPSFH 0 1/2 01/30/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.71%	90'247.58	0.01	a)
FR0013403862	0.6250 % BPCECB 0 5/8 09/22/27	100	0	0	100 EUR	91.50%	87'189.78	0.01	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	610	0	60	550 EUR	69.01%	361'682.13	0.04	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	748	270	0	1'018 EUR	89.36%	866'842.93	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	520	270	0	790 EUR	96.52%	726'543.56	0.07	a)
FR0013417334	0.8750 % ACACB 0 7/8 05/06/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	80.12%	76'347.88	0.01	a)
FR0013426731	0.3500 % RATFPF 0.35 06/20/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.58%	82'497.78	0.01	a)
FR0013431137	0.2500 % AGFRNC 0 1/4 06/29/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.91%	81'858.40	0.01	a)
FR0013432069	0.0500 % AXASFH 0.05 07/05/27	0	100	0	100 EUR	90.14%	85'895.77	0.01	a)
FR0013433596	0.2500 % FRLBP 0 1/4 07/12/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.50%	88'145.52	0.01	a)
FR0013445137	0.0000 % RTEFRA 0 09/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.89%	84'705.62	0.01	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	669	240	90	819 EUR	85.85%	669'952.05	0.07	a)
FR0013454733	0.0100 % LBPSFH 0.01 10/22/29	100	0	0	100 EUR	84.13%	80'166.08	0.01	a)
FR0013459047	0.0100 % BPCECB 0.01 11/08/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.87%	87'544.25	0.01	a)
FR0013480514	0.2500 % CRH 0 1/4 02/07/35	100	0	0	100 EUR	73.05%	69'610.04	0.01	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	317	310	0	627 EUR	54.11%	323'278.48	0.03	a)
FR0013505518	0.1250 % BPIFRA 0 1/8 03/25/25	100	0	0	100 EUR	96.31%	91'768.39	0.01	a)
FR0013505633	2.7500 % ADPPF 2 3/4 04/02/30	100	0	0	100 EUR	96.19%	91'661.66	0.01	a)
FR0013506870	0.1250 % CMCICB 0 1/8 04/09/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.22%	91'690.25	0.01	a)
FR0013507647	0.6250 % SNCF 0 5/8 04/17/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.76%	81'714.51	0.01	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	754	30	0	784 EUR	94.37%	705'030.94	0.07	a)
FR0013508686	0.6250 % FRPTT 0 5/8 10/21/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.90%	88'525.72	0.01	a)
FR0013511615	0.0100 % CAFFIL 0.01 05/07/25	100	0	0	100 EUR	95.86%	91'345.31	0.01	a)
FR0013515715	0.0100 % CMARK 0.01 10/04/30	100	0	0	100 EUR	81.80%	77'948.72	0.01	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	318	150	0	468 EUR	66.56%	296'823.94	0.03	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	718	260	0	978 EUR	83.47%	777'826.98	0.08	a)
FR0013518487	0.2500 % UNEDIC 0 1/4 11/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.14%	82'084.23	0.01	a)
FR0013519568	0.0100 % CAFFIL 0.01 06/24/30	0	100	0	100 EUR	82.49%	78'603.35	0.01	a)
FR0013521630	2.5000 % CNPFP 2 1/2 06/30/51 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.23%	82'163.32	0.01	a)
FR0013524410	0.2500 % UNEDIC 0 1/4 07/16/35 EMTN	100	0	0	100 EUR	73.39%	69'934.97	0.01	a)
FR0013534559XXX	0.0000 % CADES 0 11/25/30	100	0	0	100 EUR	82.36%	78'476.62	0.01	a)
FR00140002P5	0.0000 % CADES 0 02/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.97%	84'780.89	0.01	a)
FR00140005B8	0.0000 % SOGRPR 0 11/25/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.57%	77'729.56	0.01	a)
FR0014000C08	0.8750 % SNCF 0 7/8 02/28/51	100	0	0	100 EUR	49.17%	46'855.18	0.00	a)
FR0014000L31	0.0000 % UNEDIC 0 11/19/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	82.51%	78'620.50	0.01	a)
FR0014000UG9	0.0000 % CADES 0 02/25/26	100	0	0	100 EUR	93.89%	89'466.22	0.01	a)
FR0014001IP3	0.6250 % FRPTT 0 5/8 01/18/36 EMTN	100	100	0	100 EUR	72.10%	68'706.70	0.01	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	220	0	220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072	80	110	0	190 EUR	38.91%	70'451.15	0.01	a)
FR0014001ZD3	0.1250 % CAFFIL 0 1/8 02/15/36	100	0	0	100 EUR	69.41%	66'141.54	0.01	a)
FR0014002FB7	0.0100 % BPCECB 0.01 03/18/31	100	0	0	100 EUR	80.48%	76'687.10	0.01	a)
FR0014002GI0	0.0000 % CADES 0 05/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.97%	81'914.62	0.01	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	190	220	0	410 EUR	59.98%	234'346.80	0.02	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	752	150	0	902 EUR	81.04%	696'556.65	0.07	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	443	270	0	713 EUR	92.07%	625'522.17	0.06	a)
FR0014003BW0	0.0100 % CMCICB 0.01 05/06/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.24%	76'457.46	0.01	a)
FR0014003RL9	0.0100 % CDCEPS 0.01 06/01/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.03%	88'650.55	0.01	a)
FR0014004016	0.0000 % CADES 0 11/25/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.10%	87'762.47	0.01	a)
FR0014004I65	0.0100 % CFF 0.01 07/15/26	0	100	0	100 EUR	92.61%	88'246.53	0.01	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	581	0	80	501 EUR	52.94%	252'732.69	0.03	a)
FR0014004QY2	0.0100 % UNEDIC 0.01 11/25/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.15%	76'375.51	0.01	a)
FR00140058G6	0.3000 % SOGRPR 0.3 09/02/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	68.94%	65'691.78	0.01	a)
FR0014005FC8	0.1250 % CADES 0 1/8 09/15/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.34%	77'506.58	0.01	a)
FR0014005N34	0.0100 % CAFFIL 0.01 10/01/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.21%	80'238.50	0.01	a)
FR0014005NA6	0.1250 % AGFRNC 0 1/8 09/29/31	100	0	0	100 EUR	79.67%	75'919.08	0.01	a)
FR0014006276	0.0100 % CFF 0.01 10/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.10%	84'900.96	0.01	a)
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	100	0	0	100 EUR	54.29%	51'731.09	0.01	a)
FR0014006TX3	0.7500 % VDP 0 3/4 11/30/41 EMTN	0	100	0	100 EUR	63.67%	60'671.04	0.01	a)
FR0014006UI2	0.0100 % SOCSFH 0.01 12/02/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.73%	87'411.80	0.01	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	380	340	0	720 EUR	79.81%	547'536.70	0.06	a)
FR0014007LP4	0.7500 % RTEFRA 0 3/4 01/12/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.07%	73'438.72	0.01	a)
FR0014007PX9	0.3750 % CAFFIL 0 3/8 01/20/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.81%	77'006.32	0.01	a)
FR0014007RB1	0.4500 % CADES 0.45 01/19/32	100	0	0	100 EUR	82.67%	78'770.10	0.01	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	569	0	220	349 EUR	96.71%	321'621.85	0.03	a)
FR0014008066	0.1250 % SOCSFH 0 1/8 02/02/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.44%	82'369.15	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR00140084Y5	0.1250 % BPIFRA 0 1/8 11/25/28	100	0	0	100 EUR	87.10%	82'994.24	0.01	a)
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	100	0	0	100 EUR	69.73%	66'448.37	0.01	a)
FR0014008E08	0.6250 % CRLNCB 0 5/8 02/16/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.63%	86'357.91	0.01	a)
FR0014008JP6	0.7500 % BPCECB 0 3/4 02/23/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.05%	84'849.50	0.01	a)
FR0014008SA9	1.1250 % AGFRNC 1 1/8 03/02/37 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.35%	72'752.65	0.01	a)
FR0014009ED1	0.8750 % ACACB 0 7/8 08/31/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.40%	88'041.66	0.01	a)
FR0014009N55	1.3750 % ALSFR 1 3/8 04/13/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.08%	82'978.99	0.01	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	90	200	0	290 EUR	78.72%	217'540.13	0.02	a)
FR001400A2T9	1.7500 % SOCSFH 1 3/4 05/05/34	100	0	0	100 EUR	87.75%	83'615.52	0.01	a)
FR001400A3H2	1.5000 % CADES 1 1/2 05/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.62%	85'393.60	0.01	a)
FR001400A4J6	1.5000 % SFILFR 1 1/2 03/05/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.48%	84'307.31	0.01	a)
FR001400ADP1	1.7500 % UNEDIC 1 3/4 11/25/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.07%	86'776.23	0.01	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	560	280	0	840 EUR	92.58%	741'046.73	0.08	a)
FR001400BB83	2.1250 % BPIFRA 2 1/8 11/29/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.50%	91'951.34	0.01	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	657	150	0	807 EUR	93.78%	721'123.46	0.07	a)
FR001400CGA2	2.1250 % ACACB 2 1/8 01/07/30	0	100	0	100 EUR	94.71%	90'248.54	0.01	a)
FR001400CM22	2.3750 % CFF 2 3/8 03/15/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.96%	91'442.50	0.01	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	70	210	0	280 EUR	89.40%	238'531.10	0.02	a)
FR001400CVE3	2.7500 % CADES 2 3/4 11/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.47%	93'829.47	0.01	a)
FR001400D5T9	2.7500 % CRH 2 3/4 04/12/28	100	0	0	100 EUR	98.36%	93'721.80	0.01	a)
FR001400DAO4	5.3750 % ORANOF 5 3/8 05/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	104.05%	99'148.47	0.01	a)
FR001400DGZ7	3.1250 % BPCECB 3 1/8 01/24/28	0	100	0	100 EUR	99.70%	95'005.33	0.01	a)
FR001400DHQ4	3.3750 % BPIFRA 3 3/8 11/25/32	100	0	0	100 EUR	102.26%	97'440.90	0.01	a)
FR001400DLD4	5.5000 % FRLBP 5 1/2 03/05/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.52%	98'643.44	0.01	a)
FR001400DZIB	2.8750 % CADES 2 7/8 05/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.60%	94'905.28	0.01	a)
FR001400F281	3.0000 % CRH 3 01/11/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.21%	94'532.70	0.01	a)
FR001400F5S9	3.1250 % BPCECB 3 1/8 01/20/33	0	100	0	100 EUR	99.80%	95'093.95	0.01	a)
FR001400F5U5	3.0000 % CADES 3 05/25/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.09%	95'374.10	0.01	a)
FR001400FDC8	4.6250 % EDF 4 5/8 01/25/43 EMTN	100	0	0	100 EUR	103.65%	98'766.36	0.01	a)
FR001400FIG8	3.0000 % BNPPCB 3 01/31/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.65%	94'958.64	0.01	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	400	0	400 EUR	93.73%	357'266.47	0.04	a)
FR001400FWP0	3.0000 % BPCECB 3 10/17/29	0	100	0	100 EUR	99.26%	94'587.02	0.01	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	860	0	860 EUR	99.08%	811'924.10	0.08	a)
FR001400FZ24	3.1250 % CMCICB 3 1/8 06/22/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.82%	95'120.63	0.01	a)
FR001400G5Z3	3.2500 % ACACB 3 1/4 09/28/32	0	100	0	100 EUR	100.73%	95'987.75	0.01	a)
FR001400G6E6	3.1250 % CADES 3 1/8 03/01/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.12%	96'357.47	0.01	a)
FR001400GI73	3.3750 % CFF 3 3/8 09/16/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.51%	96'723.38	0.01	a)
FR001400H4K7	3.7000 % SOGRPR 3.7 05/25/53 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.99%	96'226.93	0.01	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	680	0	680 EUR	101.23%	655'924.14	0.07	a)
FR001400HCM5	3.2500 % CMCICB 3 1/4 04/20/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.43%	95'697.12	0.01	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	0	620	0	620 EUR	100.08%	591'272.14	0.06	a)
FR001400I2W5	3.0000 % BNPPCB 3 05/25/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.63%	94'935.77	0.01	a)
FR001400ICR2	3.2500 % CMARK 3 1/4 08/01/33	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400IVT8	3.0000 % CADES 3 11/25/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.33%	95'600.88	0.01	a)
FR001400KFO8	3.3750 % ACACB 3 3/8 09/04/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.87%	96'121.16	0.01	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33	0	450	80	370 EUR	105.15%	370'738.15	0.04	a)
FR001400NBC6	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/27	0	130	0	130 EUR	99.02%	122'660.87	0.01	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49	0	140	0	140 EUR	95.47%	127'361.82	0.01	a)
FR001400NJB1	3.0000 % SOCSFH 3 02/01/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.44%	94'752.82	0.01	a)
GR0114032577	0.0000 % GGB 0 02/12/26	0	80	0	80 EUR	94.75%	72'224.75	0.01	a)
GR0114033583	3.8750 % GGB 3 7/8 06/15/28	0	60	0	60 EUR	103.59%	59'223.80	0.01	a)
GR0118019679	1.8750 % GGB 1 7/8 07/23/26	0	50	0	50 EUR	97.98%	46'683.66	0.00	a)
GR0118020685	2.0000 % GGB 2 04/22/27	0	70	0	70 EUR	97.87%	65'277.75	0.01	a)
GR0124034688	3.7500 % GGB 3 3/4 01/30/28	0	100	0	100 EUR	103.04%	98'185.10	0.01	a)
GR0124035693	3.8750 % GGB 3 7/8 03/12/29	0	70	0	70 EUR	104.17%	69'481.30	0.01	a)
GR0124036709	1.5000 % GGB 1 1/2 06/18/30	0	100	0	100 EUR	90.84%	86'557.07	0.01	a)
GR0124037715	0.7500 % GGB 0 3/4 06/18/31	0	100	0	100 EUR	84.32%	80'344.27	0.01	a)
GR0124038721	1.7500 % GGB 1 3/4 06/18/32	0	70	0	70 EUR	89.14%	59'456.02	0.01	a)
GR0124039737	4.2500 % GGB 4 1/4 06/15/33	0	80	0	80 EUR	107.08%	81'629.33	0.01	a)
GR0124040743	3.3750 % GGB 3 3/8 06/15/34	0	70	0	70 EUR	99.28%	66'224.25	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GR0128015725	3.9000 % GGB 3.9 01/30/33	0	120	0	120 EUR	104.22%	119'170.26	0.01	a)
GR0128016731	1.8750 % GGB 1 7/8 02/04/35	0	80	0	80 EUR	84.99%	64'787.68	0.01	a)
GR0128017747	4.3750 % GGB 4 3/8 07/18/38	0	65	0	65 EUR	107.11%	66'338.07	0.01	a)
GR0133011248	4.0000 % GGB 4 01/30/37	0	100	0	100 EUR	103.87%	98'975.04	0.01	a)
GR0138015814	4.2000 % GGB 4.2 01/30/42	0	90	0	90 EUR	104.96%	90'014.03	0.01	a)
GR0138017836	1.8750 % GGB 1 7/8 01/24/52	0	55	0	55 EUR	68.25%	35'770.96	0.00	a)
HK0000929676	3.3750 % HKINTL 3 3/8 06/07/27 GMTN	0	100	0	100 EUR	99.88%	95'176.85	0.01	a)
IE000GVLBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	80	0	0	80 EUR	100.39%	76'528.73	0.01	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	190	0	0	190 EUR	101.98%	184'638.02	0.02	a)
IE00B6X95T99	3.4000 % IRISH 3.4 03/18/24	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDP44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	150	0	0	150 EUR	93.28%	133'330.30	0.01	a)
IE00BFZRP202	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	105	0	0	105 EUR	88.56%	88'609.72	0.01	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	134	0	0	134 EUR	91.92%	117'368.04	0.01	a)
IE00BH35Q895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	121	40	0	161 EUR	92.68%	142'176.63	0.01	a)
IE00BH35QB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	121	60	0	145 EUR	72.46%	100'109.69	0.01	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	153	30	0	183 EUR	98.66%	172'039.25	0.02	a)
IE00BKFVC345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	74	30	0	104 EUR	77.13%	76'433.75	0.01	a)
IE00BKFVC568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	95	50	0	145 EUR	92.45%	127'739.16	0.01	a)
IE00BKFVC899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	68	70	0	138 EUR	85.39%	112'282.12	0.01	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	50	40	0	90 EUR	82.23%	70'518.33	0.01	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	105	100	0	205 EUR	81.96%	160'109.37	0.02	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	34	40	0	74 EUR	67.73%	47'756.59	0.00	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	169	0	0	169 EUR	84.19%	135'580.52	0.01	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	121	70	0	191 EUR	96.17%	175'024.64	0.02	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	72	85	0	157 EUR	86.65%	129'623.25	0.01	a)
IT0000366655	9.0000 % BTPS 9 11/01/23 30Y	105	0	105	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	114	70	0	184 EUR	110.18%	193'172.18	0.02	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	440	130	80	490 EUR	111.25%	519'445.22	0.05	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	458	80	0	538 EUR	109.73%	562'532.23	0.06	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	479	70	0	549 EUR	115.87%	606'175.10	0.06	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	396	80	0	476 EUR	115.40%	523'418.12	0.05	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	248	280	50	478 EUR	109.89%	500'529.61	0.05	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	440	115	0	555 EUR	100.31%	530'484.42	0.05	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	387	140	60	467 EUR	109.41%	486'866.26	0.05	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	367	70	0	437 EUR	101.37%	422'131.51	0.04	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	370	40	0	410 EUR	109.42%	427'500.07	0.04	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	390	0	0	390 EUR	102.26%	380'012.08	0.04	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	263	270	0	533 EUR	106.05%	538'619.07	0.06	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	178	170	0	348 EUR	106.61%	353'522.40	0.04	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24 11Y	191	0	191	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24 10Y	179	0	179	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	311	180	0	491 EUR	100.55%	470'429.64	0.05	a)
IT0005038283	2.8750 % MONTE 2 7/8 07/16/24 16	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	339	0	339	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	182	100	0	282 EUR	86.14%	231'480.22	0.02	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	312	40	0	352 EUR	97.65%	327'522.64	0.03	a)
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	265	170	0	435 EUR	86.67%	359'267.43	0.04	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	171	160	0	331 EUR	97.80%	308'471.81	0.03	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	358	0	0	358 EUR	78.26%	266'956.45	0.03	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	388	0	0	388 EUR	96.43%	356'519.79	0.04	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	216	120	0	336 EUR	83.11%	266'079.50	0.03	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	360	0	0	360 EUR	94.90%	325'532.79	0.03	a)
IT0005212987	0.3750 % UCGIM 0 3/8 10/31/26	100	0	0	100 EUR	92.35%	87'994.97	0.01	a)
IT0005215246	0.6500 % BTPS 0.65 10/15/23 7Y	131	0	131	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	167	0	0	167 EUR	72.65%	115'604.28	0.01	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	392	0	0	392 EUR	89.97%	336'080.14	0.03	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	174	160	0	334 EUR	96.91%	308'438.27	0.03	a)
IT0005246340	1.8500 % BTPS 1.85 05/15/24 7Y	130	0	130	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	232	100	0	332 EUR	88.57%	280'184.99	0.03	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	343	0	0	343 EUR	96.26%	314'628.29	0.03	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	210	0	210	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0005283491	1.1250 % ISPIM 1 1/8 10/04/27	100	0	0	100 EUR	92.52%	88'162.68	0.01	a)
IT0005315046	1.2500 % BACRED 1 1/4 11/24/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.96%	84'769.46	0.01	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	152	120	0	272 EUR	87.67%	227'232.04	0.02	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	250	140	0	390 EUR	95.52%	354'986.89	0.04	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	190	90	0	280 EUR	97.69%	260'652.10	0.03	a)
IT0005339186	1.1250 % BACRED 1 1/8 08/12/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005339210	1.1250 % ISPIM 1 1/8 07/14/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.66%	92'105.71	0.01	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	383	0	0	383 EUR	97.96%	357'520.21	0.04	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	341	0	0	341 EUR	98.68%	320'634.37	0.03	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	287	0	0	287 EUR	95.12%	260'142.77	0.03	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	249	120	90	279 EUR	93.82%	249'429.97	0.03	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	246	140	0	386 EUR	98.25%	361'368.90	0.04	a)
IT0005367492	1.7500 % BTPS 1 3/4 07/01/24 5Y	137	0	137	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	168	130	0	298 EUR	97.43%	276'670.01	0.03	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	146	150	0	296 EUR	87.70%	247'349.62	0.03	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	413	0	0	413 EUR	88.72%	349'157.30	0.04	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	211	70	0	281 EUR	97.15%	260'118.35	0.03	a)
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	167	150	0	317 EUR	93.58%	282'662.46	0.03	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	155	110	0	265 EUR	72.31%	182'587.89	0.02	a)
IT0005399586	1.0000 % CDEP 1 02/11/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.32%	81'301.92	0.01	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	150	90	0	240 EUR	76.32%	174'535.46	0.02	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	175	150	0	325 EUR	85.68%	265'336.81	0.03	a)
IT0005408098	2.0000 % CDEP 2 04/20/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.32%	90'832.66	0.01	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	288	0	0	288 EUR	97.98%	268'892.41	0.03	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	417	0	0	417 EUR	88.98%	353'564.14	0.04	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	225	200	0	425 EUR	92.48%	374'529.38	0.04	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	185	130	0	315 EUR	94.84%	284'661.09	0.03	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	176	160	0	336 EUR	71.40%	228'584.53	0.02	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	258	160	0	418 EUR	83.79%	333'732.01	0.03	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24 4Y	125	0	125	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	312	0	0	312 EUR	60.79%	180'731.41	0.02	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	200	130	0	330 EUR	69.47%	218'452.61	0.02	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	358	0	0	358 EUR	88.77%	302'836.74	0.03	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	221	190	40	371 EUR	81.05%	286'534.81	0.03	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	219	110	0	329 EUR	93.47%	293'014.63	0.03	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	162	60	0	222 EUR	62.94%	133'137.00	0.01	a)
IT0005439275	0.0000 % BTPS 0 04/15/24 3Y	144	0	144	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	42	50	0	92 EUR	60.23%	52'799.04	0.01	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	308	0	0	308 EUR	88.90%	260'907.97	0.03	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	379	0	0	379 EUR	82.48%	297'870.58	0.03	a)
IT0005452989	0.0000 % BTPS 0 08/15/24 3Y	140	0	140	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454050	0.0000 % BTPS 0 01/30/24 3Y	163	0	163	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	236	60	0	296 EUR	92.54%	261'009.47	0.03	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	385	0	0	385 EUR	81.24%	298'048.15	0.03	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	148	170	0	318 EUR	87.04%	263'751.98	0.03	a)
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	203	0	100	103 EUR	97.33%	95'524.50	0.01	a)
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	114	70	0	184 EUR	66.19%	116'049.53	0.01	a)
IT0005482309	0.0000 % BTPS 0 11/29/23 2Y	140	0	140	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	281	0	0	281 EUR	93.83%	251'228.71	0.03	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	140	130	0	270 EUR	96.90%	249'295.16	0.03	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	160	250	0	410 EUR	91.45%	357'259.32	0.04	a)
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	310	0	0	310 EUR	97.29%	287'388.67	0.03	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	150	60	0	210 EUR	91.15%	182'394.17	0.02	a)
IT0005499311	1.7500 % BTPS 1 3/4 05/30/24 2Y	95	0	95	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	225	90	0	315 EUR	97.97%	294'059.05	0.03	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	100	110	0	210 EUR	101.18%	202'468.76	0.02	a)
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	312	0	0	312 EUR	100.28%	298'126.11	0.03	a)
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	60	260	0	320 EUR	105.36%	321'269.59	0.03	a)
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	257	120	0	377 EUR	102.23%	367'258.80	0.04	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	50	230	0	280 EUR	100.52%	268'186.74	0.03	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	175	0	0	175 EUR	102.32%	170'614.96	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	94	190	0	284 EUR	102.62%	277'698.27	0.03	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	0	260	0	260 EUR	99.83%	247'323.55	0.03	a)
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	0	270	0	270 EUR	101.03%	259'920.76	0.03	a)
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	210	0	210 EUR	103.00%	206'106.67	0.02	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	0	270	0	270 EUR	101.27%	260'548.52	0.03	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	340	0	340 EUR	104.66%	339'068.11	0.03	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	0	320	0	320 EUR	102.06%	311'210.19	0.03	a)
IT0005549396	3.5000 % CARPP 3 1/2 01/15/30	0	100	0	100 EUR	100.15%	95'434.13	0.01	a)
IT0005552507	3.7500 % BAMIIIM 3 3/4 06/27/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.86%	96'111.63	0.01	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	0	350	0	350 EUR	101.44%	338'295.04	0.03	a)
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	0	210	0	210 EUR	100.28%	200'669.81	0.02	a)
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	0	390	0	390 EUR	103.26%	383'724.61	0.04	a)
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	0	310	0	310 EUR	102.90%	303'945.50	0.03	a)
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	0	180	0	180 EUR	103.44%	177'415.83	0.02	a)
IT0005580045	2.9500 % BTPS 2.95 02/15/27 3Y	0	130	0	130 EUR	99.16%	122'839.25	0.01	a)
IT0005580094	3.5000 % BTPS 3 1/2 02/15/31 7Y	0	150	0	150 EUR	99.80%	142'642.35	0.01	a)
LU1556942974	0.6250 % LGB 0 5/8 02/01/27	40	0	0	40 EUR	93.42%	35'605.44	0.00	a)
LU2161837203	0.0000 % LGB 0 04/28/25	40	0	0	40 EUR	96.20%	36'667.71	0.00	a)
LU2228213398	0.0000 % LGB 0 09/14/32	0	20	0	20 EUR	78.93%	15'042.41	0.00	a)
LU2320463339	0.0000 % LGB 0 03/24/31	40	0	0	40 EUR	82.34%	31'383.79	0.00	a)
LU2475493826	1.3750 % LGB 1 3/8 05/25/29	50	0	0	50 EUR	93.09%	44'351.48	0.00	a)
LU2475494477	1.7500 % LGB 1 3/4 05/25/42	50	0	0	50 EUR	81.99%	39'061.55	0.00	a)
LU2591860569	3.0000 % LGB 3 03/02/33	0	20	0	20 EUR	101.21%	19'287.69	0.00	a)
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	262	60	0	322 EUR	112.96%	346'599.55	0.04	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	246	0	0	246 EUR	110.18%	258'281.56	0.03	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	191	150	0	341 EUR	113.11%	367'531.98	0.04	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	181	110	25	266 EUR	98.98%	250'879.08	0.03	a)
NL0010418810	1.7500 % NETHER 1 3/4 07/15/23	112	0	112	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	367	0	0	367 EUR	99.74%	348'784.97	0.04	a)
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	131	0	131	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	190	140	0	330 EUR	96.17%	302'417.46	0.03	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	206	100	0	306 EUR	94.75%	276'259.66	0.03	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	174	140	0	314 EUR	93.89%	280'914.96	0.03	a)
NL0012650469	0.0000 % NETHER 0 01/15/24	144	0	144	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	171	170	0	341 EUR	92.32%	299'984.86	0.03	a)
NL0013088990	1.0000 % NNGRNV 1 09/25/28	100	0	0	100 EUR	91.01%	86'719.06	0.01	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	123	90	0	213 EUR	88.36%	179'347.25	0.02	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	208	40	0	248 EUR	70.84%	167'398.51	0.02	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	154	120	0	274 EUR	84.87%	221'592.34	0.02	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	167	90	0	257 EUR	82.66%	202'436.72	0.02	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	103	110	0	213 EUR	68.05%	138'111.02	0.01	a)
NL0015000LS8	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	264	0	40	224 EUR	88.15%	188'150.41	0.02	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	35	220	0	255 EUR	94.66%	230'014.71	0.02	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	248	0	0	248 EUR	84.11%	198'755.16	0.02	a)
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	130	40	0	170 EUR	85.09%	137'839.06	0.01	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	108	90	0	198 EUR	98.49%	185'825.75	0.02	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	0	140	0	140 EUR	99.26%	132'415.15	0.01	a)
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	0	120	25	95 EUR	106.72%	96'602.60	0.01	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	301	0	0	301 EUR	92.59%	265'550.35	0.03	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	132	150	0	282 EUR	48.01%	129'011.85	0.01	a)
PTOTESOE0007	4.1000 % PGB 4.1 04/15/37	181	0	0	181 EUR	108.88%	187'780.50	0.02	a)
PTOTEAOE0021	4.9500 % PGB 4.95 10/25/23	59	0	59	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
PTOTEBOE0020	4.1000 % PGB 4.1 02/15/45	60	25	0	85 EUR	109.03%	88'307.32	0.01	a)
PTOTECOE0037	1.0000 % PGB 1 04/12/52	65	50	0	115 EUR	55.58%	60'907.64	0.01	a)
PTOTEKOE0011	2.8750 % PGB 2 7/8 10/15/25	130	60	0	190 EUR	99.90%	180'863.17	0.02	a)
PTOTELOE0028	0.4750 % PGB 0.475 10/18/30	196	0	0	196 EUR	86.53%	161'613.48	0.02	a)
PTOTEMOE0035	0.7000 % PGB 0.7 10/15/27	68	70	0	138 EUR	93.47%	122'916.35	0.01	a)
PTOTENOE0034	0.9000 % PGB 0.9 10/12/35	64	40	0	104 EUR	78.31%	77'608.08	0.01	a)
PTOTEPOE0033	0.3000 % PGB 0.3 10/17/31	76	100	0	176 EUR	82.96%	139'135.15	0.01	a)
PTOTEQOE0032	1.1500 % PGB 1.15 04/11/42	38	30	0	68 EUR	69.51%	45'038.45	0.00	a)
PTOTEQOE0015	5.6500 % PGB 5.65 02/15/24	113	0	113	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
PTOTEROE0014	3.8750 % PGB 3 7/8 02/15/30	70	50	0	120 EUR	106.38%	121'638.99	0.01	a)
PTOTETOE0012	2.8750 % PGB 2 7/8 07/21/26	116	80	0	196 EUR	100.42%	187'545.82	0.02	a)
PTOTEUOE0019	4.1250 % PGB 4 1/8 04/14/27	89	60	0	149 EUR	104.34%	148'145.80	0.02	a)
PTOTEVOE0018	2.1250 % PGB 2 1/8 10/17/28	223	70	0	293 EUR	97.93%	273'404.33	0.03	a)
PTOTEWOE0017	2.2500 % PGB 2 1/4 04/18/34 15Y	107	50	0	157 EUR	93.19%	139'407.27	0.01	a)
PTOTEXOE0024	1.9500 % PGB 1.95 06/15/29	192	20	0	212 EUR	96.49%	194'920.68	0.02	a)
PTOTEYOE0031	1.6500 % PGB 1.65 07/16/32	110	0	0	110 EUR	90.80%	95'175.04	0.01	a)
PTOTEZOE0014	3.5000 % PGB 3 1/2 06/18/38	0	70	0	70 EUR	101.83%	67'921.15	0.01	a)
SI0002102984	4.6250 % SLOREP 4 5/8 09/09/24 RS66	20	0	20	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SI0002103487	1.5000 % SLOREP 1 1/2 03/25/35 RS74	20	50	0	70 EUR	83.33%	55'583.97	0.01	a)
SI0002103552	3.1250 % SLOREP 3 1/8 08/07/45 RS76	25	0	0	25 EUR	94.97%	22'623.12	0.00	a)
SI0002103602	2.2500 % SLOREP 2 1/4 03/03/32 RS77	80	0	0	80 EUR	94.14%	71'766.60	0.01	a)
SI0002103677	1.7500 % SLOREP 1 3/4 11/03/40 RS78	70	0	0	70 EUR	79.28%	52'882.55	0.01	a)
SI0002103685	1.2500 % SLOREP 1 1/4 03/22/27 RS79	70	0	0	70 EUR	94.70%	63'169.31	0.01	a)
SI0002103776	1.0000 % SLOREP 1 03/06/28 RS80	40	0	0	40 EUR	92.58%	35'287.56	0.00	a)
SI0002103842	1.1875 % SLOREP 1.1875 03/14/29 RS81	30	0	0	30 EUR	91.94%	26'282.43	0.00	a)
SI0002103990	0.8750 % SLOREP 0 7/8 07/15/30 RS84	40	0	0	40 EUR	87.77%	33'452.31	0.00	a)
SI0002104048	0.4875 % SLOREP 0.4875 10/20/50 RS85	30	0	0	30 EUR	49.39%	14'117.44	0.00	a)
SI0002104105	0.0000 % SLOREP 0 02/12/31 RS86	20	0	0	20 EUR	80.99%	15'434.61	0.00	a)
SI0002104246	0.0000 % SLOREP 0 02/13/26 RS89	30	40	0	70 EUR	93.87%	62'613.01	0.01	a)
SI0002104303	3.6250 % SLOREP 3 5/8 03/11/33 RS91	0	35	0	35 EUR	103.44%	34'498.19	0.00	a)
SK4000017059	1.0000 % SLOVGB 1 10/09/30 237	20	0	0	20 EUR	86.13%	16'413.99	0.00	a)
SK4000017158	0.2500 % SLOVGB 0 1/4 05/14/25 238	40	0	0	40 EUR	96.14%	36'645.61	0.00	a)
SK4000017166	1.0000 % SLOVGB 1 05/14/32 239	40	0	0	40 EUR	82.64%	31'496.61	0.00	a)
SK4000017380	0.1250 % SLOVGB 0 1/8 06/17/27 241	0	30	0	30 EUR	90.13%	25'766.16	0.00	a)
SK4000018958	0.3750 % SLOVGB 0 3/8 04/21/36 242	65	0	0	65 EUR	66.94%	41'457.81	0.00	a)
SK4000019857	1.0000 % SLOVGB 1 10/13/51 243	0	65	0	65 EUR	51.87%	32'125.70	0.00	a)
SK4000021986	4.0000 % SLOVGB 4 10/19/32 244	40	40	0	80 EUR	103.02%	78'529.79	0.01	a)
SK4000022398	3.2500 % SLOSP0 3 1/4 01/12/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.13%	94'458.38	0.01	a)
SK4000022539	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 02/23/35 245	0	60	0	60 EUR	99.31%	56'779.65	0.01	a)
SK4000022547	4.0000 % SLOVGB 4 02/23/43 246	50	0	0	50 EUR	100.51%	47'888.58	0.00	a)
SK4000022828	3.5000 % VUBSK 3 1/2 10/13/26	0	100	0	100 EUR	99.56%	94'871.93	0.01	a)
SK4000023230	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 06/08/33 247	0	40	0	40 EUR	100.15%	38'172.51	0.00	a)
SK4120007543	4.3500 % SLOVGB 4.35 10/14/25 216	60	0	0	60 EUR	101.26%	57'892.81	0.01	a)
SK4120008871	3.3750 % SLOVGB 3 3/8 11/15/24 223	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK4120009762	3.6250 % SLOVGB 3 5/8 01/16/29 227	30	45	0	75 EUR	101.94%	72'849.13	0.01	a)
SK4120010430	1.3750 % SLOVGB 1 3/8 01/21/27 228	70	0	0	70 EUR	94.60%	63'099.27	0.01	a)
SK4120011420	1.6250 % SLOVGB 1 5/8 01/21/31 229	80	0	0	80 EUR	89.02%	67'863.59	0.01	a)
SK4120011636	0.0000 % SLOVGB 0 11/13/23 230	20	0	20	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK4120012220	0.6250 % SLOVGB 0 5/8 05/22/26 231	20	0	0	20 EUR	94.31%	17'973.67	0.00	a)
SK4120012691	1.8750 % SLOVGB 1 7/8 03/09/37 232	20	0	0	20 EUR	80.37%	15'315.69	0.00	a)
SK4120013400	2.0000 % SLOVGB 2 10/17/47 233	60	0	0	60 EUR	70.12%	40'086.85	0.00	a)
SK4120014150	1.0000 % SLOVGB 1 06/12/28 234	30	30	0	60 EUR	91.32%	52'212.10	0.01	a)
SK4120015173	0.7500 % SLOVGB 0 3/4 04/09/30 236	40	0	0	40 EUR	85.83%	32'713.25	0.00	a)
XS0162990229	5.6250 % EDF 5 5/8 02/21/33 EMTN	50	0	0	50 EUR	114.29%	54'453.95	0.01	a)
XS0177618039	5.0000 % RESFER 5 10/10/33 EMTN	50	0	0	50 EUR	113.56%	54'104.72	0.01	a)
XS0219724878	4.0000 % EIB 4 10/15/37 EARN	80	50	0	130 EUR	110.58%	136'980.80	0.01	a)
XS0290050524	4.1250 % EIB 4 1/8 04/15/24 EARN	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0427291751	4.5000 % EIB 4 1/2 10/15/25 EARN	120	60	0	180 EUR	102.06%	175'048.87	0.02	a)
XS0479333311	5.2500 % POLAND 5 1/4 01/20/25 EMTN	60	0	0	60 EUR	101.23%	57'878.52	0.01	a)
XS0488101527	4.1250 % SNCF 4 1/8 02/19/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.30%	47'789.01	0.00	a)
XS0505157965	4.0000 % EIB 4 04/15/30 EARN	100	50	0	150 EUR	106.62%	152'393.21	0.02	a)
XS0520578096	3.8750 % OBND 3 7/8 06/30/25 EMTN	55	0	0	55 EUR	100.48%	52'661.20	0.01	a)
XS0542825160	3.3750 % ASFING 3 3/8 09/22/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	100.03%	47'656.56	0.00	a)
XS0611783928	4.2500 % RESFER 4 1/4 10/07/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	102.43%	97'605.75	0.01	a)
XS0755873253	3.5000 % EIB 3 1/2 04/15/27 EARN	0	50	0	50 EUR	101.89%	48'542.26	0.00	a)
XS0782697071	3.3750 % OBND 3 3/8 05/18/32 EMTN	80	0	0	80 EUR	103.03%	78'538.17	0.01	a)
XS0790003023	2.7500 % ASFING 2 3/4 06/11/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.82%	94'163.94	0.01	a)
XS0807336077	2.7500 % EIB 2 3/4 09/15/25 EMTN	90	0	0	90 EUR	99.39%	85'232.94	0.01	a)
XS0878008225	2.6250 % EIB 2 5/8 03/15/35 1981	50	0	0	50 EUR	96.73%	46'088.11	0.00	a)
XS0975634204	3.0000 % EIB 3 10/14/33 EARN	40	60	0	100 EUR	100.85%	96'100.19	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS0985666436	3.1250 % RESFER 3 1/8 10/25/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.96%	95'253.08	0.01	a)
XS1015428821	3.0000 % POLAND 3 01/15/24 EMTN	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1023039545	2.1250 % EIB 2 1/8 01/15/24 EARN	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1081100239	2.2500 % NWDIE 2 1/4 06/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.46%	90'960.34	0.01	a)
XS1107247725	1.7500 % EIB 1 3/4 09/15/45 EMTN	50	0	0	50 EUR	78.82%	37'555.04	0.00	a)
XS1117298916	3.0000 % CROATI 3 03/11/25	0	100	0	100 EUR	99.36%	94'677.54	0.01	a)
XS1169595698	0.8750 % ONT 0 7/8 01/21/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.56%	92'963.30	0.01	a)
XS1192872866	0.6250 % RENTEN 0 5/8 02/20/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.05%	167'804.67	0.02	a)
XS1204140971	0.6250 % NDAFH 0 5/8 03/17/27 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1207450005	0.8750 % AGFRNC 0 7/8 05/25/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.37%	162'702.93	0.02	a)
XS1208855889	2.6250 % BGARIA 2 5/8 03/26/27 GMTN	100	0	0	100 EUR	98.31%	93'680.82	0.01	a)
XS1243995641	0.7500 % COE 0 3/4 06/09/25 EMTN	40	0	0	40 EUR	96.73%	36'870.49	0.00	a)
XS1247736793	0.8750 % EIB 0 7/8 09/13/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1298431799	1.5000 % ABNAV 1 1/2 09/30/30	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1309518998	1.2500 % DBHNGR 1 1/4 10/23/25 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.74%	46'090.49	0.00	a)
XS1309529680	1.3750 % BNG 1 3/8 10/21/30 EMTN	0	70	0	70 EUR	90.52%	60'377.17	0.01	a)
XS1310032260	2.1250 % LITHUN 2 1/8 10/22/35 EMTN	20	0	0	20 EUR	86.84%	16'550.44	0.00	a)
XS1312891549	2.7500 % ROMANI 2 3/4 10/29/25 REGS	60	0	0	60 EUR	98.01%	56'032.97	0.01	a)
XS1313004928	3.8750 % ROMANI 3 7/8 10/29/35 REGS	0	50	0	50 EUR	84.53%	40'271.23	0.00	a)
XS1314321941	4.2500 % CYPRUS 4 1/4 11/04/25 EMTN	20	0	0	20 EUR	102.15%	19'467.79	0.00	a)
XS1342516629	1.0000 % BNG 1 01/12/26 EMTN	50	0	0	50 EUR	96.11%	45'790.33	0.00	a)
XS1346201889	2.3750 % POLAND 2 3/8 01/18/36 EMTN	40	0	0	40 EUR	86.81%	33'088.68	0.00	a)
XS1369323149	3.3750 % MEX 3 3/8 02/23/31	100	0	0	100 EUR	95.74%	91'226.20	0.01	a)
XS1379610675	0.3750 % RENTEN 0 3/8 03/16/26 EMTN	60	0	0	60 EUR	94.64%	54'105.67	0.01	a)
XS1394055872	0.3750 % EIB 0 3/8 04/14/26 EARN	80	0	0	80 EUR	94.66%	72'156.90	0.01	a)
XS1394791492	1.0000 % ABNAV 1 04/13/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.23%	83'115.25	0.01	a)
XS1422953932	1.0000 % EIB 1 04/14/32 EARN	50	0	0	50 EUR	86.95%	41'426.60	0.00	a)
XS1428088626	3.0000 % CROATI 3 03/20/27	100	0	0	100 EUR	99.65%	94'957.69	0.01	a)
XS1431730388	0.1250 % NIB 0 1/8 06/10/24 EMTN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1458458665	0.5000 % CBAAU 0 1/2 07/27/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.31%	88'913.55	0.01	a)
XS1489409679	0.0000 % EIB 0 10/16/23 EARN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1499594916	0.7500 % NEDWBK 0 3/4 10/04/41 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1500338618	0.5000 % EIB 0 1/2 11/13/37 EMTN	0	180	80	100 EUR	71.90%	68'512.32	0.01	a)
XS1501554874	0.3750 % LATVIA 0 3/8 10/07/26 GMTN	100	0	0	100 EUR	93.25%	88'851.61	0.01	a)
XS1501560848	0.1250 % AFDB 0 1/8 10/07/26 GDIF	50	0	0	50 EUR	92.75%	44'191.40	0.00	a)
XS1508377584	0.8750 % BNG 0 7/8 10/24/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.77%	73'150.95	0.01	a)
XS1508566392	1.0000 % POLAND 1 10/25/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	91.93%	43'799.28	0.00	a)
XS1547374212	0.2500 % BNG 0 1/4 01/10/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1551294256	1.5000 % ISRAEL 1 1/2 01/18/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.27%	87'919.69	0.01	a)
XS1555331617	0.5000 % EIB 0 1/2 01/15/27 EARN	90	0	0	90 EUR	93.52%	80'203.15	0.01	a)
XS1564325550	0.2500 % RENTEN 0 1/4 07/15/24 EMTN	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1575991358	0.2500 % EIB 0 1/4 10/14/24 EARN	40	0	0	40 EUR	98.04%	37'366.75	0.00	a)
XS1586702679	0.8750 % SBAB 0 7/8 03/29/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.07%	88'680.09	0.01	a)
XS1612977717	1.1250 % EIB 1 1/8 04/13/33 EARN	90	0	0	90 EUR	86.11%	73'844.94	0.01	a)
XS1617533275	0.8750 % KBN 0 7/8 05/24/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.46%	89'053.62	0.01	a)
XS1619567677	0.9500 % LITHUN 0.95 05/26/27 EMTN	30	40	0	70 EUR	92.49%	61'692.53	0.01	a)
XS1632891138	0.6250 % BNG 0 5/8 06/19/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.96%	88'575.27	0.01	a)
XS1648462023	2.2500 % RESFER 2 1/4 12/20/47 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.93%	73'306.27	0.01	a)
XS1673096829	0.2500 % RENTEN 0 1/4 08/29/25 EMTN	15	0	0	15 EUR	95.83%	13'697.37	0.00	a)
XS1686550960	0.0500 % EIB 0.05 12/15/23 EARN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1696445516	1.7500 % REPHUN 1 3/4 10/10/27	0	50	0	50 EUR	93.15%	44'378.64	0.00	a)
XS1747670922	1.2500 % ABNAV 1 1/4 01/10/33 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1748479919	0.5000 % SANUK 0 1/2 01/10/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1751001139	1.7500 % MEX 1 3/4 04/17/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.26%	87'908.26	0.01	a)
XS1753042743	1.5000 % EIB 1 1/2 10/16/48 EARN	80	0	0	80 EUR	71.94%	54'838.06	0.01	a)
XS1766477522	0.8750 % RABOBK 0 7/8 02/08/28	100	0	0	100 EUR	92.09%	87'753.89	0.01	a)
XS1766612672	1.1250 % POLAND 1 1/8 08/07/26 EMTN	40	0	0	40 EUR	95.64%	36'453.13	0.00	a)
XS1767087866	1.5000 % ACEIM 1 1/2 06/08/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.90%	89'476.70	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1768074319	3.3750 % ROMANI 3 3/8 02/08/38 REGS	30	0	0	30 EUR	77.52%	22'159.97	0.00	a)
XS1788529490	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 03/04/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.25%	207'840.54	0.02	a)
XS1788694856	1.0000 % DEVOPA 1 03/08/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.22%	87'875.86	0.01	a)
XS1791485011	0.8750 % EIB 0 7/8 01/14/28 EARN	110	0	0	110 EUR	92.82%	97'295.49	0.01	a)
XS1805353734	1.4500 % ABNAV 1.45 04/12/38	0	100	0	100 EUR	79.64%	75'886.68	0.01	a)
XS1807469199	0.5000 % BNG 0 1/2 04/16/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.80%	92'234.35	0.01	a)
XS1829345427	0.6250 % OPBANK 0 5/8 09/01/25	100	0	0	100 EUR	95.86%	91'347.21	0.01	a)
XS1843433639	0.8300 % CHILE 0.83 07/02/31	100	0	0	100 EUR	81.29%	77'458.94	0.01	a)
XS1843434876	1.1250 % CROATI 1 1/8 06/19/29	0	100	0	100 EUR	90.30%	86'047.27	0.01	a)
XS1850111789	0.3750 % EIB 0 3/8 07/16/25 EARN	50	0	0	50 EUR	96.23%	45'848.46	0.00	a)
XS1851229218	0.8750 % Q 0 7/8 07/05/28	100	0	0	100 EUR	91.23%	86'926.79	0.01	a)
XS1881014374	0.2000 % EIB 0.2 07/15/24 EARN	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1883355601	0.5000 % HESLAN 0 1/2 09/25/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.58%	91'071.83	0.01	a)
XS1883942648	2.3750 % CYPRUS 2 3/8 09/25/28 EMTN	20	25	0	45 EUR	97.30%	41'721.14	0.00	a)
XS1897486632	1.5000 % BNG 1 1/2 07/15/39 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.05%	75'324.48	0.01	a)
XS1909057645	3.2500 % LOGICR 3 1/4 11/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.83%	90'362.88	0.01	a)
XS1912495691	0.6250 % IBRD 0 5/8 11/22/27 GDIF	0	20	0	20 EUR	92.21%	17'573.46	0.00	a)
XS1934743656	0.6250 % DNBNO 0 5/8 01/14/26	100	0	0	100 EUR	95.02%	90'538.21	0.01	a)
XS1936137139	0.6250 % DEXGRP 0 5/8 01/17/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.14%	90'658.28	0.01	a)
XS1936139770	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 12/18/28 EMTN	60	0	0	60 EUR	91.39%	52'251.55	0.01	a)
XS1938387237	0.6250 % EIB 0 5/8 01/22/29 EARN	60	40	0	100 EUR	90.08%	85'837.64	0.01	a)
XS1940071597	0.7500 % BNG 0 3/4 01/24/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.25%	86'001.54	0.01	a)
XS1942618023	0.7500 % NAB 0 3/4 01/30/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.97%	90'499.15	0.01	a)
XS1942756096	0.6250 % COE 0 5/8 01/30/29 EMTN	60	0	0	60 EUR	90.09%	51'506.59	0.01	a)
XS1947578321	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 02/06/29 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1951092144	0.3750 % RENTEN 0 3/8 02/14/28 EMTN	0	60	0	60 EUR	90.78%	51'901.65	0.01	a)
XS1952576475	0.7500 % INTNED 0 3/4 02/18/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.51%	85'288.78	0.01	a)
XS1956027947	2.1250 % FUMVFH 2 1/8 02/27/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.82%	88'443.78	0.01	a)
XS1956050923	2.7500 % CYPRUS 2 3/4 02/26/34 EMTN	20	0	0	20 EUR	95.76%	18'249.43	0.00	a)
XS1963717704	0.2500 % NDAFH 0 1/4 03/18/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.01%	89'580.57	0.01	a)
XS1968706876	4.6250 % ROMANI 4 5/8 04/03/49 REGS	65	0	0	65 EUR	83.68%	51'827.37	0.01	a)
XS1978200472	0.3750 % WSTP 0 3/8 04/02/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.87%	89'450.97	0.01	a)
XS1978552237	0.1000 % EIB 0.1 10/15/26 EARN	50	60	0	110 EUR	93.01%	97'493.60	0.01	a)
XS1980857319	1.0000 % EIB 1 11/14/42	50	0	0	50 EUR	70.11%	33'405.23	0.00	a)
XS1989383788	2.7500 % CYPRUS 2 3/4 05/03/49 EMTN	20	0	0	20 EUR	84.10%	16'028.26	0.00	a)
XS1995620967	0.1250 % SPABOL 0 1/8 05/14/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.19%	88'795.39	0.01	a)
XS1999841445	0.0100 % KFW 0.01 05/05/27 EMTN	60	40	0	100 EUR	91.37%	87'061.14	0.01	a)
XS2001737324	0.7500 % TELNO 0 3/4 05/31/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.16%	89'726.36	0.01	a)
XS2002504194	0.0500 % SWEDA 0.05 05/28/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2009861480	1.1250 % ESBIRE 1 1/8 06/11/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.05%	82'948.50	0.01	a)
XS2012546714	1.4500 % INDON 1.45 09/18/26	100	0	0	100 EUR	94.15%	89'710.16	0.01	a)
XS2013677864	0.5000 % LITHUN 0 1/2 06/19/29 EMTN	40	0	0	40 EUR	85.60%	32'627.11	0.00	a)
XS2013678086	1.6250 % LITHUN 1 5/8 06/19/49 EMTN	40	0	0	40 EUR	65.55%	24'983.84	0.00	a)
XS2014373851	0.7500 % RABOBK 0 3/4 06/21/39 EMTN	0	100	0	100 EUR	70.55%	67'227.83	0.01	a)
XS2015227494	0.1250 % EIB 0 1/8 06/20/29 EARN	80	0	0	80 EUR	86.89%	66'237.59	0.01	a)
XS2016138765	0.5000 % IBRD 0 1/2 06/21/35 GDIF	50	0	0	50 EUR	76.30%	36'353.93	0.00	a)
XS2024540622	0.7500 % KSA 0 3/4 07/09/27 REGS	100	0	0	100 EUR	91.17%	86'875.33	0.01	a)
XS2026171079	1.1250 % FERROV 1 1/8 07/09/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.47%	90'016.99	0.01	a)
XS2055781962	0.0500 % EIB 0.05 10/13/34 EARN	50	0	0	50 EUR	74.00%	35'255.26	0.00	a)
XS2058989489	0.0100 % DANBNK 0.01 01/14/28	0	100	0	100 EUR	88.38%	84'212.97	0.01	a)
XS2079798562	0.0000 % NEDWBK 0 11/16/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084429963	0.0000 % RENTEN 0 11/27/29 EMTN	50	60	0	110 EUR	85.25%	89'355.59	0.01	a)
XS2101336316	0.3750 % ABNAV 0 3/8 01/14/35	100	100	100	100 EUR	74.80%	71'279.49	0.01	a)
XS2102284622	0.1000 % BNG 0.1 01/15/30	0	100	0	100 EUR	84.94%	80'936.01	0.01	a)
XS2102380776	0.7500 % DBHNGR 0 3/4 07/16/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	75.82%	72'244.76	0.01	a)
XS2102495673	0.0500 % EIB 0.05 01/16/30 EARN	50	30	0	80 EUR	85.33%	65'043.82	0.01	a)
XS2102988354	0.0000 % IBRD 0 01/15/27 GMTN	40	0	0	40 EUR	92.02%	35'072.59	0.00	a)
XS2105085208	0.0500 % COE 0.05 01/21/30 EMTN	0	30	0	30 EUR	85.24%	24'367.13	0.00	a)
XS2105097393	1.2500 % CYPRUS 1 1/4 01/21/40 EMTN	0	30	0	30 EUR	71.41%	20'413.91	0.00	a)
XS2113737097	0.0100 % DAA 0.01 02/06/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.15%	82'093.76	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2120068403	0.0000 % EIB 0 03/25/25 EARN	80	0	0	80 EUR	96.50%	73'561.83	0.01	a)
XS2122894855	0.0000 % IBRD 0 02/21/30 GDIF	80	0	0	80 EUR	84.52%	64'432.45	0.01	a)
XS2152799529	0.2000 % Q 0.2 04/07/25	100	0	0	100 EUR	96.39%	91'851.29	0.01	a)
XS2153459123	2.0000 % LUC5HI 2 04/06/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.16%	88'768.71	0.01	a)
XS2154343623	0.0000 % COE 0 04/09/27 EMTN	0	30	0	30 EUR	91.39%	26'126.06	0.00	a)
XS2157184255	1.5000 % CYPRUS 1 1/2 04/16/27 EMTN	20	0	0	20 EUR	95.44%	18'188.83	0.00	a)
XS2160861808	0.0100 % IBRD 0.01 04/24/28 GDIF	60	0	0	60 EUR	88.98%	50'873.11	0.01	a)
XS2161992198	1.1250 % REPHUN 1 1/8 04/28/26	40	0	0	40 EUR	94.05%	35'846.33	0.00	a)
XS2161992511	1.6250 % REPHUN 1 5/8 04/28/32	35	0	0	35 EUR	80.19%	26'744.43	0.00	a)
XS2168038417	0.2500 % LITHUN 0 1/4 05/06/25 EMTN	20	0	0	20 EUR	96.18%	18'329.86	0.00	a)
XS2168038847	0.7500 % LITHUN 0 3/4 05/06/30 EMTN	20	0	0	20 EUR	85.04%	16'206.45	0.00	a)
XS2168048564	0.0000 % EIB 0 06/17/27 EARN	90	0	0	90 EUR	91.09%	78'114.90	0.01	a)
XS2178833690	1.3750 % EQNR 1 3/8 05/22/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.73%	81'685.93	0.01	a)
XS2178857954	3.6240 % ROMANI 3.624 05/26/30 REGS	40	0	0	40 EUR	91.57%	34'902.59	0.00	a)
XS2181347183	0.1250 % ESTONI 0 1/8 06/10/30	25	0	0	25 EUR	83.03%	19'779.48	0.00	a)
XS2181689659	1.7500 % REPHUN 1 3/4 06/05/35	40	0	0	40 EUR	74.20%	28'282.34	0.00	a)
XS2190201983	1.5000 % CROATI 1 1/2 06/17/31	100	0	0	100 EUR	88.69%	84'506.46	0.01	a)
XS2199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	100	100	0	100 EUR	72.34%	68'932.54	0.01	a)
XS2209794408	0.0000 % KFW 0 09/15/28 EMTN	110	0	0	110 EUR	88.16%	92'401.58	0.01	a)
XS2210006339	0.5000 % LITHUN 0 1/2 07/28/50 EMTN	30	0	0	30 EUR	48.46%	13'853.30	0.00	a)
XS2225428809	0.0000 % EIB 0 09/09/30 EARN	50	50	0	100 EUR	83.31%	79'383.76	0.01	a)
XS2230845328	0.0000 % FINNVE 0 09/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.35%	86'090.15	0.01	a)
XS2233120554	0.0000 % RENTEN 0 09/22/27 EMTN	60	0	0	60 EUR	90.30%	51'627.79	0.01	a)
XS2234568983	0.0100 % SPABOL 0.01 09/22/27	100	0	0	100 EUR	89.12%	84'924.78	0.01	a)
XS2234571425	0.3750 % BGARIA 0 3/8 09/23/30	100	0	0	100 EUR	81.17%	77'348.40	0.01	a)
XS2234571771	1.3750 % BGARIA 1 3/8 09/23/50	50	0	0	50 EUR	60.71%	28'924.77	0.00	a)
XS2237321190	0.0100 % SVEGNO 0.01 11/24/25	100	0	0	100 EUR	94.35%	89'904.55	0.01	a)
XS2251330184	0.1250 % IBRD 0 1/8 01/03/51 GMTN	0	40	0	40 EUR	46.20%	17'608.14	0.00	a)
XS2251371022	0.0000 % EIB 0 03/28/28 EARN	50	50	0	100 EUR	89.20%	85'001.01	0.01	a)
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	30	40	0	70 EUR	65.80%	43'886.47	0.00	a)
XS2259191273	0.5000 % REPHUN 0 1/2 11/18/30	50	0	0	50 EUR	78.29%	37'299.19	0.00	a)
XS2259626856	0.2500 % CHINA 0 1/4 11/25/30	100	0	0	100 EUR	81.93%	78'069.74	0.01	a)
XS2262211076	1.3750 % ROMANI 1 3/8 12/02/29 REGS	50	0	0	50 EUR	82.51%	39'309.30	0.00	a)
XS2262263622	0.0100 % ONT 0.01 11/25/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.56%	77'720.98	0.01	a)
XS2283340060	0.0000 % EIB 0 01/14/31 EARN	90	40	0	130 EUR	82.64%	102'363.97	0.01	a)
XS2286422071	0.0000 % COE 0 01/20/31 EMTN	30	0	0	30 EUR	82.56%	23'599.87	0.00	a)
XS2287879733	0.0100 % EIB 0.01 05/15/41 EMTN	60	60	0	120 EUR	59.21%	67'700.84	0.01	a)
XS2289588167	2.1250 % MEX 2 1/8 10/25/51	100	0	0	100 EUR	58.36%	55'609.32	0.01	a)
XS2291793813	0.0000 % NEDWBK 0 02/16/37 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2291793813XXX	0.0000 % *RETIRED*	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2291901994	0.0100 % SORBNO 0.01 01/26/28	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	100	0	0	100 EUR	93.14%	88'755.37	0.01	a)
XS2297209293	0.0000 % CYPRUS 0 02/09/26 EMTN	30	0	30	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2306986782	0.1250 % ENBW 0 1/8 03/01/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	89.46%	42'622.95	0.00	a)
XS2308323661	0.2000 % EIB 0.2 03/17/36 EARN	80	60	0	140 EUR	71.86%	95'865.21	0.01	a)
XS2314020806	1.2500 % PERU 1 1/4 03/11/33	100	0	0	100 EUR	78.44%	74'743.22	0.01	a)
XS2317123052XXX	0.0000 % LATVIA 0 03/17/31 GMTN	100	0	0	100 EUR	78.62%	74'915.69	0.01	a)
XS2330503694	2.0000 % ROMANI 2 04/14/33 REGS	40	0	0	40 EUR	75.02%	28'592.60	0.00	a)
XS2331327564	0.0000 % KFW 0 06/15/29 EMTN	50	0	0	50 EUR	86.39%	41'158.37	0.00	a)
XS2332592760	0.1250 % BNG 0 1/8 04/19/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.41%	73'761.75	0.01	a)
XS2333658073	0.0000 % KUNTA 0 04/21/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.77%	84'587.46	0.01	a)
XS2337335710	0.0100 % CM 0.01 04/30/29	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2338991941	0.2500 % Q 0 1/4 05/05/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.07%	78'205.04	0.01	a)
XS2341719503	0.0100 % DNBNO 0.01 05/12/28	100	0	0	100 EUR	87.69%	83'556.44	0.01	a)
XS2343538372	0.0000 % EIB 0 09/28/28 EARN	50	0	0	50 EUR	88.05%	41'951.17	0.00	a)
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.44%	76'646.13	0.01	a)
XS2348324414	0.0100 % WSTPNZ 0.01 06/08/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.62%	82'536.85	0.01	a)
XS2351089508	0.0500 % BMO 0.05 06/08/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.67%	80'675.87	0.01	a)
XS2353057123	0.1000 % ASIA 0.1 06/17/31 GMTN	60	0	0	60 EUR	82.00%	46'882.43	0.00	a)
XS2356409966	0.0100 % EUROF 0.01 06/23/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.02%	83'870.89	0.01	a)
XS2357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	50	0	0	50 EUR	59.94%	28'555.53	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2360589217	0.0100 % NAB 0.01 01/06/29	100	0	0	100 EUR	85.30%	81'277.14	0.01	a)
XS2364199757	1.7500 % ROMANI 1 3/4 07/13/30 REGS	60	0	0	60 EUR	80.91%	46'259.82	0.00	a)
XS2364200514	2.8750 % ROMANI 2 7/8 04/13/42 REGS	0	40	0	40 EUR	66.29%	25'265.13	0.00	a)
XS2364756036	0.0000 % IDAWBG 0 07/15/31	60	0	0	60 EUR	81.06%	46'341.58	0.00	a)
XS2386139732	0.0000 % RENTEN 0 12/13/28 EMTN	50	0	0	50 EUR	87.49%	41'682.45	0.00	a)
XS2387713238	0.4000 % ABNANV 0.4 09/17/41 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388390507	0.0100 % WSTP 0.01 09/22/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.76%	81'723.09	0.01	a)
XS2388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	50	0	0	50 EUR	81.27%	38'718.99	0.00	a)
XS2388495942	0.0000 % EIB 0 12/22/26 EARN	50	50	0	100 EUR	92.33%	87'976.86	0.01	a)
XS2388560604	0.5550 % CHILE 0.555 01/21/29	100	0	0	100 EUR	86.45%	82'376.77	0.01	a)
XS2391570418	0.0100 % SHBASS 0.01 09/30/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.41%	77'574.24	0.01	a)
XS2400299363	0.7000 % IBRD 0.7 10/22/46	40	0	0	40 EUR	61.27%	23'354.03	0.00	a)
XS2405489092	0.0500 % RENTEN 0.05 01/31/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.60%	78'705.31	0.01	a)
XS2406569579	0.8750 % TENN 0 7/8 06/16/35 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.79%	79'844.00	0.01	a)
XS2408460041	0.0000 % KOMMUN 0 11/17/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.13%	81'115.15	0.01	a)
XS2412060092	0.0000 % ICO 0 04/30/25 GMTN	30	0	0	30 EUR	96.01%	27'446.47	0.00	a)
XS2429205540	0.2500 % BAWAG 0 1/4 01/12/32	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2430965538	0.2500 % BNG 0 1/4 01/12/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.17%	77'345.54	0.01	a)
XS2432629504	0.7000 % IDAWBG 0.7 01/17/42	55	0	0	55 EUR	65.82%	34'496.38	0.00	a)
XS2433126807	0.0100 % HESLAN 0.01 07/19/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.17%	85'925.31	0.01	a)
XS2433363509	0.2500 % EIB 0 1/4 01/20/32 EARN	100	0	0	100 EUR	82.06%	78'192.66	0.01	a)
XS2433385650	0.2500 % NEDWBK 0 1/4 01/19/32 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2434393968	0.9500 % CYPRUS 0.95 01/20/32 EMTN	50	0	0	50 EUR	85.20%	40'590.93	0.00	a)
XS2434895558	2.1250 % ROMANI 2 1/8 03/07/28 REGS	80	0	0	80 EUR	91.26%	69'567.35	0.01	a)
XS2434895806	3.7500 % ROMANI 3 3/4 02/07/34 REGS	30	0	0	30 EUR	86.12%	24'619.84	0.00	a)
XS2435614693	0.3750 % BNS 0 3/8 03/26/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.17%	80'207.05	0.01	a)
XS2435663393	0.2500 % KUNTA 0 1/4 02/25/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.15%	77'329.34	0.01	a)
XS2436160936	0.1250 % NACN 0 1/8 01/27/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.08%	86'788.62	0.01	a)
XS2439543047	0.0500 % EIB 0.05 11/15/29	40	50	0	90 EUR	85.68%	73'475.31	0.01	a)
XS2442748971	0.7230 % KHFC 0.723 03/22/25 REGS	100	0	0	100 EUR	96.74%	92'177.17	0.01	a)
XS2445188423	0.5000 % INTNED 0 1/2 02/17/27	100	0	0	100 EUR	92.49%	88'129.33	0.01	a)
XS2446284783	0.7500 % CBAAU 0 3/4 02/28/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.51%	86'246.43	0.01	a)
XS2446841657	0.3750 % EIB 0 3/8 09/15/27 EARN	50	0	0	50 EUR	91.72%	43'699.71	0.00	a)
XS2447602793	2.7500 % POLAND 2 3/4 05/25/32 EMTN	40	0	0	40 EUR	94.69%	36'090.65	0.00	a)
XS2448412879	0.5000 % EDC 0 1/2 02/25/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2449505820	0.7500 % RABOBK 0 3/4 03/02/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.83%	79'883.07	0.01	a)
XS2451376219	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 03/03/34 EMTN	60	0	0	60 EUR	84.00%	48'024.75	0.00	a)
XS2453958766	0.1000 % RENTEN 0.1 03/08/27 EMTN	60	0	0	60 EUR	91.93%	52'559.71	0.01	a)
XS2454011839	0.3750 % CM 0 3/8 03/10/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2454764429	0.1250 % COE 0 1/8 03/10/27 EMTN	40	0	0	40 EUR	91.96%	35'048.96	0.00	a)
XS2456253082	0.2500 % ANZ 0 1/4 03/17/25	100	0	0	100 EUR	96.56%	92'010.42	0.01	a)
XS2457002538	0.4500 % BNS 0.45 03/16/26	100	0	0	100 EUR	94.06%	89'631.07	0.01	a)
XS2461741212	0.8640 % TD 0.864 03/24/27 GMTN	100	0	0	100 EUR	92.81%	88'434.25	0.01	a)
XS2462455689	0.7500 % SEB 0 3/4 06/28/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.32%	87'973.05	0.01	a)
XS2463550702	1.2500 % BNG 1 1/4 03/30/37 EMTN	0	100	0	100 EUR	79.60%	75'848.56	0.01	a)
XS2465609191	1.0000 % BMO 1 04/05/26	100	0	0	100 EUR	95.06%	90'583.95	0.01	a)
XS2469466390	1.2500 % RFLBNI 1 1/4 04/21/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2475492349	1.7500 % IDAWBG 1 3/4 05/05/37 EMTN	50	0	0	50 EUR	85.49%	40'728.62	0.00	a)
XS2475954900	1.3750 % KFW 1 3/8 06/07/32	60	40	0	100 EUR	89.71%	85'483.17	0.01	a)
XS2478299204	2.1250 % TENN 2 1/8 11/17/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.05%	90'575.38	0.01	a)
XS2478299386	2.3750 % TENN 2 3/8 05/17/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.14%	88'754.42	0.01	a)
XS2478523108	1.7500 % SPABOL 1 3/4 05/11/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.54%	85'324.04	0.01	a)
XS2481285349	1.5000 % RY 1 1/2 09/15/27	100	0	0	100 EUR	94.07%	89'639.65	0.01	a)
XS2484093393	1.5000 % EIB 1 1/2 06/15/32 EARN	80	50	0	130 EUR	90.28%	111'832.97	0.01	a)
XS2484106716	1.3750 % EIBKOR 1 3/8 11/24/25 REGS	100	0	0	100 EUR	96.20%	91'662.62	0.01	a)
XS2484327999	1.8750 % DBHNGR 1 7/8 05/24/30 EMTN	60	0	0	60 EUR	93.03%	53'190.33	0.01	a)
XS2485360981	2.5000 % HERIM 2 1/2 05/25/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.01%	90'528.69	0.01	a)
XS2486282358	3.0000 % BGOSK 3 05/30/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.66%	92'105.71	0.01	a)
XS2487016250	2.3750 % STEDIN 2 3/8 06/03/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.58%	89'174.64	0.01	a)
XS2489466446	2.0000 % ASIA 2 06/10/37 GMTN	40	0	0	40 EUR	88.50%	33'733.22	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2490472102	2.8750 % ORSTED 2 7/8 06/14/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.77%	88'395.18	0.01	a)
XS2491074923	2.5520 % BZLNZ 2.552 06/29/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2491156142	1.8750 % NIBCAP 1 7/8 06/16/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.86%	91'342.45	0.01	a)
XS2491189408	2.5000 % AEMSPA 2 1/2 06/15/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.27%	92'683.15	0.01	a)
XS2498042584	3.3750 % NEGANV 3 3/8 07/11/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.87%	94'207.77	0.01	a)
XS2498154207	2.0000 % KFW 2 11/15/29	40	50	0	90 EUR	95.84%	82'191.91	0.01	a)
XS2500414623	1.5000 % OKB 1 1/2 07/13/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.38%	90'881.25	0.01	a)
XS2523326853	2.0000 % BAWAG 2 08/25/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.81%	86'532.29	0.01	a)
XS2524675050	1.6250 % SRBANK 1 5/8 03/15/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.14%	89'704.44	0.01	a)
XS2525157470	2.6250 % HESLAN 2 5/8 08/24/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.36%	89'914.08	0.01	a)
XS2526379313	2.1250 % DBJJP 2 1/8 09/01/26 GMTN	100	0	0	100 EUR	97.18%	92'605.02	0.01	a)
XS2526825463	2.0000 % CCDJ 2 08/31/26 GMTN	100	0	0	100 EUR	96.56%	92'010.42	0.01	a)
XS2526846469	2.3750 % RFLBNI 2 3/8 08/31/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2531420730	2.6250 % ALLRNV 2 5/8 09/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.86%	93'246.31	0.01	a)
XS2532312548	2.8750 % STATK 2 7/8 09/13/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.79%	93'184.37	0.01	a)
XS2532370231	4.0000 % ESTONI 4 10/12/32	30	0	0	30 EUR	105.18%	30'066.42	0.00	a)
XS2532376949	2.5000 % NDAFH 2 1/2 09/14/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.67%	91'164.26	0.01	a)
XS2532472235	2.2500 % AFDB 2 1/4 09/14/29 EMTN	60	0	0	60 EUR	96.72%	55'299.44	0.01	a)
XS2534984716	2.6250 % COVBS 2 5/8 12/07/26	100	0	0	100 EUR	97.76%	93'150.07	0.01	a)
XS2535352962	2.2500 % EIB 2 1/4 03/15/30 EARN	60	0	0	60 EUR	96.85%	55'372.62	0.01	a)
XS2536806289	2.5000 % EIKBOL 2 1/2 09/22/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.05%	92'479.24	0.01	a)
XS2538440780	5.0000 % ROMANI 5 09/27/26 REGS	40	0	0	60 EUR	102.26%	58'466.26	0.01	a)
XS2538441598	6.6250 % ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS	40	40	0	80 EUR	106.98%	81'547.76	0.01	a)
XS2541853532	2.8120 % DBSSP 2.812 10/13/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2545248242	3.7500 % VATFAL 3 3/4 10/18/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.44%	95'711.42	0.01	a)
XS2548490734	3.0000 % NEDFIN 3 10/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.53%	95'789.55	0.01	a)
XS2550557800	3.1250 % SPMTBK 3 1/8 11/01/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.68%	94'980.56	0.01	a)
XS2558395278	4.0490 % ENBW 4.049 11/22/29 EMTN	0	50	0	50 EUR	102.98%	49'064.44	0.01	a)
XS2559401802	2.7500 % SEK 2 3/4 02/23/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.61%	93'959.07	0.01	a)
XS2570759154	3.1250 % BAWAG 3 1/8 01/12/29	100	100	100	100 EUR	99.47%	94'784.26	0.01	a)
XS2574388646	2.8750 % EIB 2 7/8 01/12/33 EARN	80	0	0	80 EUR	99.94%	76'185.69	0.01	a)
XS2576298991	2.8750 % COE 2 7/8 01/17/33 EMTN	30	0	0	30 EUR	99.89%	28'554.20	0.00	a)
XS2577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	0	80	0	80 EUR	101.46%	77'343.64	0.01	a)
XS2577109049	2.9000 % IBRD 2.9 01/19/33 EMTN	70	0	0	70 EUR	100.01%	66'706.51	0.01	a)
XS2577526580	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 01/19/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.51%	93'871.40	0.01	a)
XS2579293536	4.0000 % ENBW 4 01/24/35 EMTN	60	0	0	60 EUR	100.67%	57'554.35	0.01	a)
XS2580224082	2.7500 % OPBANK 2 3/4 01/25/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.90%	93'291.09	0.01	a)
XS2582112947	3.0000 % ACHMEA 3 01/31/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.35%	94'667.06	0.01	a)
XS2582348046	3.2500 % LLOYDS 3 1/4 02/02/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.58%	94'886.22	0.01	a)
XS2583211201	4.6250 % AMCOSP 4 5/8 02/06/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	101.33%	96'554.72	0.01	a)
XS2585966505	3.0000 % INTNED 3 02/15/33	0	100	0	100 EUR	99.37%	94'688.02	0.01	a)
XS2586011491	3.0000 % AIIB 3 02/14/28 GMTN	0	40	0	40 EUR	99.96%	38'098.56	0.00	a)
XS2586942448	2.7500 % KFW 2 3/4 02/14/33 EMTN	0	80	0	80 EUR	99.38%	75'761.09	0.01	a)
XS2586944147	4.2500 % POLAND 4 1/4 02/14/43 EMTN	0	35	0	35 EUR	101.41%	33'821.17	0.00	a)
XS2586944659	3.8750 % POLAND 3 7/8 02/14/33 EMTN	0	40	0	40 EUR	102.42%	39'035.82	0.00	a)
XS2587298204	2.7500 % EIB 2 3/4 07/28/28 EARN	0	90	0	90 EUR	99.73%	85'523.67	0.01	a)
XS2587748174	2.7500 % RENTEN 2 3/4 02/16/32 EMTN	0	50	0	50 EUR	99.12%	47'222.52	0.00	a)
XS2592234749	3.2500 % SEB 3 1/4 05/04/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.31%	95'579.92	0.01	a)
XS2597408272	3.7150 % TD 3.715 03/13/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.48%	97'646.72	0.01	a)
XS2597408439	3.8790 % TD 3.879 03/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.77%	96'017.29	0.01	a)
XS2604821228	3.8750 % LITHUN 3 7/8 06/14/33 EMTN	0	40	0	40 EUR	102.56%	39'092.23	0.00	a)
XS2607344079	3.1250 % SHBASS 3 1/8 04/04/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.77%	95'072.99	0.01	a)
XS2611177382	3.1000 % IBRD 3.1 04/14/38 GMTN	0	30	0	30 EUR	99.57%	28'462.44	0.00	a)
XS2615680399	3.1250 % KUNTA 3 1/8 07/29/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.35%	96'578.54	0.01	a)
XS2626024868	2.7500 % EIB 2 3/4 07/30/30 EARN	0	60	0	60 EUR	99.48%	56'877.42	0.01	a)
XS2626288760	2.7500 % KFW 2 3/4 05/15/30 EMTN	0	80	0	80 EUR	99.84%	76'104.89	0.01	a)
XS2630524713	3.1250 % DEXGRP 3 1/8 06/01/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.40%	95'664.73	0.01	a)
XS2634616572	3.6250 % ENEXIS 3 5/8 06/12/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.39%	97'566.68	0.01	a)
XS2636439684	4.0000 % CROATI 4 06/14/35	0	100	0	100 EUR	104.00%	99'101.78	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2642546399	3.3750 % KNABNL 3 3/8 06/28/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.17%	96'401.31	0.01	a)
XS2645690525	3.2500 % ICO 3 1/4 10/31/28 GMTN	0	60	0	60 EUR	100.77%	57'610.38	0.01	a)
XS2647979181	3.0000 % EIB 3 07/15/33 EARN	0	100	0	100 EUR	100.77%	96'017.29	0.01	a)
XS2678945317	4.0820 % KHFC 4.082 09/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.92%	97'118.83	0.01	a)
XS2679922828	3.4500 % IBRD 3.45 09/13/38 EMTN	0	50	0	50 EUR	103.46%	49'292.66	0.01	a)
XS2680932907	5.3750 % REPHUN 5 3/8 09/12/33	0	40	0	40 EUR	103.89%	39'598.78	0.00	a)
XS2689948078	6.3750 % ROMANI 6 3/8 09/18/33 REGS	0	50	0	50 EUR	105.24%	50'139.29	0.01	a)
XS2689949399	5.5000 % ROMANI 5 1/2 09/18/28 REGS	0	50	0	50 EUR	102.20%	48'692.34	0.00	a)
XS2696803852	4.2500 % TELNO 4 1/4 10/03/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	105.87%	100'877.00	0.01	a)
XS2698047771	3.2500 % KFW 3 1/4 03/24/31 EMTN	0	70	0	70 EUR	102.77%	68'548.81	0.01	a)
XS2740429076	3.2500 % ESTONI 3 1/4 01/17/34	0	35	0	35 EUR	97.83%	32'628.54	0.00	a)
EUR							175'621'381.66	17.96	
BE6295393936	2.2500 % ABIBB 2 1/4 05/24/29 EMTN	30	0	30	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
BE6295395956	2.8500 % ABIBB 2.85 05/25/37 EMTN	0	30	30	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413337	2.2500 % UBS 2 1/4 06/09/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.45%	100'743.43	0.01	a)
FR0010763177	6.1250 % EDF 6 1/8 06/02/34 EMTN	50	0	0	50 GBP	102.60%	57'141.71	0.01	a)
FR0010945436	5.1250 % EDF 5 1/8 09/22/50 EMTN	100	0	0	100 GBP	86.72%	96'590.99	0.01	a)
FR0010946855	5.0000 % ENGIFP 5 10/01/60 EMTN	50	0	0	50 GBP	91.20%	50'790.52	0.01	a)
FR0013476330	1.8750 % BNP 1 7/8 12/14/27	0	100	0	100 GBP	88.60%	98'689.49	0.01	a)
FR0014001GJ0	1.2500 % BNP 1 1/4 07/13/31 EMTN	100	0	0	100 GBP	75.29%	83'865.24	0.01	a)
FR0014005DW1	1.0000 % BFCM 1 07/16/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	90.87%	101'210.14	0.01	a)
FR0014006W73	2.5000 % BPCEGP 2 1/2 11/30/32	100	0	0	100 GBP	87.05%	96'959.68	0.01	a)
FR001400FAR2	4.8750 % ACAFP 4 7/8 10/23/29	0	100	0	100 GBP	99.41%	110'730.23	0.01	a)
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	238	140	0	378 GBP	108.42%	456'474.55	0.05	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	534	230	0	764 GBP	101.84%	866'657.82	0.09	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	495	210	0	705 GBP	100.25%	787'244.33	0.08	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	327	290	0	617 GBP	100.33%	689'514.42	0.07	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	290	210	0	500 GBP	104.18%	580'188.65	0.06	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	398	80	0	478 GBP	95.38%	507'812.62	0.05	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	380	80	0	460 GBP	95.79%	490'795.82	0.05	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	554	40	0	594 GBP	100.48%	664'770.65	0.07	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	443	80	0	523 GBP	100.22%	583'826.05	0.06	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	656	110	50	716 GBP	104.55%	833'828.82	0.09	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	211	150	0	361 GBP	95.44%	383'776.75	0.04	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	217	280	90	407 GBP	98.36%	445'880.25	0.05	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	392	220	0	612 GBP	103.04%	702'413.87	0.07	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	365	130	50	445 GBP	91.60%	454'008.41	0.05	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	444	50	0	494 GBP	97.85%	538'390.52	0.06	a)
GB00B6RNHS72	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	409	0	0	409 GBP	87.54%	398'801.91	0.04	a)
GB00B7253659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	314	0	314	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	268	245	0	513 GBP	83.35%	476'261.13	0.05	a)
GB00BJJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	301	110	0	411 GBP	82.60%	378'114.18	0.04	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	407	110	0	517 GBP	53.36%	307'296.89	0.03	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	307	130	0	437 GBP	56.55%	275'254.07	0.03	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	407	340	0	747 GBP	91.02%	757'346.03	0.08	a)
GB00BF0HZ991	0.7500 % UKT 0 3/4 07/22/23	98	0	98	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFMCM652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	291	150	0	441 GBP	46.50%	228'426.74	0.02	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	289	0	289	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	477	130	70	537 GBP	58.82%	351'830.97	0.04	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	635	50	0	685 GBP	90.03%	686'949.00	0.07	a)
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	311	0	250	61 GBP	98.97%	67'243.76	0.01	a)
GB00BJLROJ16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	303	190	0	493 GBP	52.55%	288'583.71	0.03	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	721	110	70	761 GBP	84.46%	715'943.15	0.07	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	374	220	0	594 GBP	61.23%	405'128.01	0.04	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	591	225	0	816 GBP	95.19%	865'184.77	0.09	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	431	230	0	661 GBP	79.21%	583'151.55	0.06	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	548	110	0	658 GBP	92.43%	677'447.47	0.07	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	359	260	70	549 GBP	99.60%	609'064.69	0.06	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	191	0	0	191 GBP	36.85%	78'396.78	0.01	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	279	330	0	609 GBP	49.03%	332'581.21	0.03	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	192	100	0	292 GBP	96.01%	312'273.94	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	211	300	0	511	84.37%	480'209.98	0.05	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	406	100	110	396	64.56%	284'742.60	0.03	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	406	110	80	436	75.12%	364'821.99	0.04	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	628	0	0	628	79.68%	557'374.70	0.06	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	121	210	0	331	51.23%	188'892.03	0.02	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	290	100	0	390	30.00%	130'311.96	0.01	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	642	0	70	572	40.35%	257'047.35	0.03	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	284	240	0	524	85.85%	501'058.98	0.05	a)
GB00BMF9LF76	4.0000 % UKT 4 10/22/63	0	200	0	200	91.35%	203'505.16	0.02	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	0	450	0	450	101.39%	508'185.38	0.05	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	320	0	320	0	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	415	350	0	765	76.20%	649'314.63	0.07	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	638	0	0	638	67.98%	483'112.62	0.05	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	3.2500	590	0	590	94.00%	617'761.88	0.06	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	495	50	60	485	86.05%	464'868.47	0.05	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	359	210	0	569	90.51%	573'642.09	0.06	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	241	210	0	451	49.69%	249'621.31	0.03	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	0	600	0	600	98.31%	657'003.21	0.07	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	120	350	0	470	87.11%	456'035.06	0.05	a)
GB00BPJKN53	4.6250 % UKT 4 5/8 01/31/34	0	320	70	250	104.10%	289'879.91	0.03	a)
GB00BPJJKP77	4.7500 % UKT 4 3/4 10/22/43	0	220	80	140	103.03%	160'665.76	0.02	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	80	280	0	360	93.80%	376'133.47	0.04	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	554	190	0	744	96.32%	798'225.88	0.08	a)
GB00BYYMZX75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	273	80	0	353	63.98%	251'562.74	0.03	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	630	140	0	770	93.94%	805'665.55	0.08	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	582	70	110	542	74.04%	447'009.28	0.05	a)
XS0085727559	6.0000 % EIB 6 12/07/28	40	0	0	40	107.27%	47'790.92	0.00	a)
XS0089572316	6.0000 % ITALY 6 08/04/28 EMTN	50	0	0	50	102.21%	56'923.95	0.01	a)
XS0091740018	5.6250 % EBRD 5 5/8 12/07/28 EMTN	25	0	0	25	105.12%	29'272.86	0.00	a)
XS0092157600	6.7500 % THAMES 6 3/4 11/16/28 EMTN	0	40	40	0	0.00%	0.00	0.00	
XS0093312550	6.6250 % AWLN 6 5/8 01/15/29	50	0	0	50	105.35%	58'671.58	0.01	a)
XS0094835278	4.5000 % LCRFIN 4 1/2 12/07/38 REGS	30	0	0	30	98.81%	33'019.24	0.00	a)
XS0096499057	5.0000 % EIB 5 04/15/39	25	30	0	55	105.20%	64'448.69	0.01	a)
XS0097283096	5.7500 % BRITEL 5 3/4 12/07/28	0	30	30	0	0.00%	0.00	0.00	
XS0097777253	6.2500 % SVTLN 6 1/4 06/07/29	30	0	0	30	104.11%	34'788.60	0.00	a)
XS0104440986	5.7500 % ILLN 5 3/4 12/03/32 EMTN	0	40	0	40	103.39%	46'063.12	0.00	a)
XS0105290349	6.1250 % AEGON 6 1/8 12/15/31 EMTN	20	0	0	20	104.75%	23'334.75	0.00	a)
XS0110373569	5.5000 % EIB 5 1/2 04/15/25	30	0	0	30	100.48%	33'576.95	0.00	a)
XS0114126294	5.6250 % EIB 5 5/8 06/07/32	70	0	0	70	110.15%	85'883.54	0.01	a)
XS0121617517	5.7500 % WMT 5 3/4 12/19/30	30	0	0	30	107.60%	35'956.47	0.00	a)
XS0123656836	5.2500 % RESFER 5 1/4 01/31/35 EMTN	40	0	0	40	104.40%	46'515.34	0.00	a)
XS0128311023	6.0150 % GLCCUK 6.015 03/31/28 A1	40	0	0	40	102.96%	45'874.21	0.00	a)
XS0130092793	5.3750 % NEDWBK 5 3/8 06/07/32 EMTN	30	0	30	0	0.00%	0.00	0.00	
XS0134886067	5.7500 % BACR 5 3/4 09/14/26 EMTN	30	0	0	30	100.44%	33'561.91	0.00	a)
XS0138037733	6.0000 % KFW 6 12/07/28 EXCH	0	60	0	60	107.20%	71'642.27	0.01	a)
XS0138039275	5.0000 % KFW 5 06/09/36 EMTN	20	0	0	20	106.12%	23'639.72	0.00	a)
XS0140198044	6.1250 % PRUFIN 6 1/8 12/19/31 EMTN	0	30	0	30	101.50%	33'916.45	0.00	a)
XS0140516864	5.2500 % GSK 5 1/4 12/19/33 EMTN	0	40	0	40	103.75%	46'223.06	0.00	a)
XS0145680426	5.8750 % LGEN 5 7/8 04/05/33 EMTN	30	0	0	30	104.89%	35'050.91	0.00	a)
XS0146389464	5.8750 % MCD 5 7/8 04/23/32 EMTN	0	50	0	50	106.51%	59'316.50	0.01	a)
XS0147048762	6.2500 % EOANGR 6 1/4 06/03/30 EMTN	50	0	0	50	105.75%	58'893.24	0.01	a)
XS0148889420	6.1250 % UKPONE 6 1/8 06/07/27 EMTN	30	0	0	30	102.97%	34'407.66	0.00	a)
XS0150670551	5.1000 % LCRFIN 5.1 03/07/51	0	30	0	30	105.40%	35'219.32	0.00	a)
XS0159497162	5.7500 % HSBC 5 3/4 12/20/27 EMTN	0	25	0	25	101.34%	28'220.27	0.00	a)
XS0165510313	5.8750 % NGGLN 5 7/8 03/25/27	0	50	0	50	101.84%	56'717.33	0.01	a)
XS0168658853	5.1500 % C 5.15 05/21/26 EMTN	0	30	0	30	100.21%	33'485.39	0.00	a)
XS0172989252	6.1920 % SWSFIN 6.192 03/31/29 A1	30	0	0	30	102.43%	34'228.89	0.00	a)
XS0172992637	6.6400 % SWSFIN 6.64 03/31/26 A4	0	30	0	30	100.56%	33'601.34	0.00	a)
XS0181816652	5.6250 % VOD 5 5/8 12/04/25 EMTN	30	0	0	30	100.91%	33'720.64	0.00	a)
XS0184639895	6.0000 % HMSOLN 6 02/23/26	0	40	40	0	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X50195751523	5.8750 % AFFNTY 5 7/8 07/13/26	30	0	0	30 GBP	100.54%	33'595.33	0.00	a)
X50202077953	5.2500 % WMT 5 1/4 09/28/35	0	50	0	50 GBP	104.95%	58'448.81	0.01	a)
X50202407093	4.6250 % EIB 4 5/8 10/12/54 DIP	30	0	0	30 GBP	99.66%	33'303.28	0.00	a)
X50207920942XXX	5.0000 % TRANLN 5 03/31/35 EMTN	0	50	0	50 GBP	99.06%	55'167.96	0.01	a)
X50217097608	5.1820 % FWFIN 5.182 04/20/35 A	40	0	0	40 GBP	95.59%	42'587.90	0.00	a)
X50228265574	4.5500 % RABOBK 4.55 08/30/29 EMTN	0	30	0	30 GBP	100.13%	33'458.99	0.00	a)
X50232335769	4.8750 % SGN 4 7/8 03/21/29 A7	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50234964533	4.8750 % NGN 4 7/8 11/15/35	0	50	0	50 GBP	93.79%	52'235.19	0.01	a)
X50236698972	4.3750 % UKRAIL 4 3/8 12/09/30 EMTN	50	0	0	50 GBP	100.26%	55'836.83	0.01	a)
X50241945582	5.3750 % TELEFO 5 3/8 02/02/26 EMTN	50	0	0	50 GBP	100.23%	55'820.68	0.01	a)
X50261559594	4.6250 % WELLTR 4 5/8 07/25/36	50	0	0	50 GBP	100.10%	55'748.28	0.01	a)
X50268693743	5.1250 % THAMES 5 1/8 09/28/37 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50291949120	5.5000 % T 5 1/2 03/15/27	50	0	0	50 GBP	100.66%	56'060.16	0.01	a)
X50301197546	5.1250 % UPS 5 1/8 02/12/50	0	50	0	50 GBP	103.25%	57'503.71	0.01	a)
X50306647792	5.7500 % ENELIM 5 3/4 06/22/37 EMTN	50	0	0	50 GBP	101.58%	56'573.64	0.01	a)
X50306772699	6.3750 % BRITEL 6 3/8 06/23/37 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50308998144	5.1250 % SWSFIN 5 1/8 09/30/56 EMTN	0	50	0	50 GBP	88.67%	49'380.95	0.01	a)
X50340495216	5.8750 % GE 5 7/8 01/18/33 EMTN	40	0	0	40 GBP	103.77%	46'233.76	0.00	a)
X50350820931	6.3750 % GSK 6 3/8 03/09/39 EMTN	50	0	0	50 GBP	112.90%	62'876.93	0.01	a)
X50364880186	6.8750 % AVLN 6 7/8 05/20/58 EMTN	50	0	0	50 GBP	102.44%	57'052.60	0.01	a)
X50372391945	6.8000 % C 6.8 06/25/38 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50379947236	7.0000 % BAC 7 07/31/28 EMTN	50	0	0	50 GBP	107.30%	59'755.36	0.01	a)
X50383187720	6.2500 % SSELN 6 1/4 08/27/38 EMTN	50	0	0	50 GBP	108.77%	60'577.94	0.01	a)
X50387079907	6.7500 % HSBC 6 3/4 09/11/28	50	0	0	50 GBP	104.14%	57'997.70	0.01	a)
X50388006123	7.0000 % CNALN 7 09/19/33 EMTN	50	0	0	50 GBP	110.94%	61'782.57	0.01	a)
X50398990944	7.2500 % CLARHG 7 1/4 11/12/38	50	0	0	50 GBP	118.03%	65'731.73	0.01	a)
X50399412443	8.1250 % ORAFP 8 1/8 11/20/28 EMTN	50	0	0	50 GBP	113.43%	63'172.66	0.01	a)
X50410370919	7.3750 % IBESM 7 3/8 01/29/24 EMTN	50	0	50	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X50416848793	6.8750 % EQNR 6 7/8 03/11/31 EMTN	0	50	0	50 GBP	112.95%	62'903.66	0.01	a)
X50426513387	7.0000 % T 7 04/30/40 EMTN	50	0	0	50 GBP	112.61%	62'715.98	0.01	a)
X50429422271	6.5000 % HSBC 6 1/2 05/20/24 EMTN	50	0	0	50 GBP	100.14%	55'770.00	0.01	a)
X50432072022	6.5000 % PFE 6 1/2 06/03/38	50	0	0	50 GBP	115.34%	64'235.27	0.01	a)
X50437306904	6.1250 % EOANGR 6 1/8 07/06/39 EMTN	50	0	0	50 GBP	104.41%	58'150.30	0.01	a)
X50438974205	6.3500 % HOUSFN 6.35 07/08/39 EMTN	0	50	0	50 GBP	110.23%	61'389.38	0.01	a)
X50449155455	7.3750 % C 7 3/8 09/01/39 EMTN	0	50	0	50 GBP	119.90%	66'773.18	0.01	a)
X50451790280	5.7500 % KPN 5 3/4 09/17/29 GMTN	50	0	0	50 GBP	103.06%	57'394.55	0.01	a)
X50466148441	6.2500 % UKPONE 6 1/4 11/12/36 EMTN	0	50	0	50 GBP	109.54%	61'006.22	0.01	a)
X50496975110	5.7500 % NGGLN 5 3/4 03/23/40 WEST	50	0	0	50 GBP	101.72%	56'649.94	0.01	a)
X50497976562	5.7500 % WWUF 5 3/4 03/29/30	0	50	0	50 GBP	101.92%	56'759.10	0.01	a)
X50498768315	6.0000 % HSBC 6 03/29/40 EMTN	50	0	0	50 GBP	97.63%	54'372.67	0.01	a)
X50499449261	5.7500 % ORSTED 5 3/4 04/09/40 EMTN	50	0	0	50 GBP	101.56%	56'559.72	0.01	a)
X50519906761	5.7500 % AMXLMM 5 3/4 06/28/30	50	0	0	50 GBP	103.81%	57'816.70	0.01	a)
X50562107762	5.3750 % ORAFP 5 3/8 11/22/50 EMTN	0	50	0	50 GBP	100.89%	56'190.48	0.01	a)
X50562326214	5.5000 % CMCSA 5 1/2 11/23/29	50	0	0	50 GBP	103.19%	57'466.95	0.01	a)
X50564485273	5.1250 % BGGRP 5 1/8 12/01/25 EMTN	0	50	0	50 GBP	100.04%	55'712.64	0.01	a)
X50589945459	6.0000 % LLOYDS 6 02/08/29	0	100	0	100 GBP	105.75%	117'788.71	0.01	a)
X50596191360	5.7500 % SANUK 5 3/4 03/02/26 EMTN	100	0	0	100 GBP	101.30%	112'835.41	0.01	a)
X50625276257	5.8750 % HTHROW 5 7/8 05/13/41 EMTN	100	0	0	100 GBP	102.37%	114'022.77	0.01	a)
X50629875708	5.2500 % RABOBK 5 1/4 05/23/41 GMTN	50	0	0	50 GBP	105.24%	58'613.11	0.01	a)
X50954706023	3.1250 % DBHNGR 3 1/8 07/24/26 EMTN	20	0	0	20 GBP	96.40%	21'473.95	0.00	a)
X51003373047	6.3400 % MGNLN 6.34 12/19/63 EMTN	0	100	0	100 GBP	94.47%	105'230.03	0.01	a)
X51243995302	5.5600 % MGNLN 5.56 07/20/55 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51377228959	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 03/10/36 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51472483772	3.0000 % VOD 3 08/12/56 EMTN	0	100	0	100 GBP	59.73%	66'527.02	0.01	a)
X51492681033	2.6250 % CDTFIN 2 5/8 09/22/38 EMTN	100	0	0	100 GBP	69.44%	77'344.75	0.01	a)
X51595796035	2.2500 % DT 2 1/4 04/13/29 EMTN	30	30	60	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X51694801256	3.2500 % NOTHLL 3 1/4 10/12/48	0	100	0	100 GBP	70.78%	78'837.31	0.01	a)
X51708168890	3.3750 % VZ 3 3/8 10/27/36	0	100	0	100 GBP	82.27%	91'637.69	0.01	a)
X51748699011	3.2500 % BACR 3 1/4 01/17/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	83.31%	92'796.10	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS1805260483	1.3750 % EIB 1 3/8 03/07/25 EMTN	40	0	0	40 GBP	96.46%	42'975.96	0.00	a)
XS1835964625	1.2500 % IADB 1 1/4 12/15/23	30	0	30	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS1849472938	1.7500 % TTEFP 1 3/4 07/07/25 EMTN	50	0	0	50 GBP	95.93%	53'425.34	0.01	a)
XS1859424902	3.1250 % GS 3 1/8 07/25/29 EMTN	30	0	0	30 GBP	90.46%	30'227.04	0.00	a)
XS1872363558	1.3750 % RENTEN 1 3/8 09/08/25 EMTN	50	0	0	50 GBP	94.89%	52'843.91	0.01	a)
XS1941813617	1.3750 % KFW 1 3/8 12/09/24 EMTN	30	0	0	30 GBP	97.24%	32'494.28	0.00	a)
XS1948630634	3.1250 % DT 3 1/8 02/06/34 EMTN	30	0	30	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2022043256	2.0000 % UU 2 07/03/33 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.25%	86'041.70	0.01	a)
XS2055646678	2.1250 % WFC 2 1/8 09/24/31 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2065728177	0.5000 % IADB 0 1/2 09/15/26	30	0	0	30 GBP	90.36%	30'194.96	0.00	a)
XS2083961370	3.7500 % LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN	0	100	0	100 GBP	88.62%	98'705.08	0.01	a)
XS2084420582	1.7500 % KEL 1 3/4 11/26/26	100	0	0	100 GBP	90.02%	100'268.93	0.01	a)
XS2100726244	0.8750 % KFW 0 7/8 07/18/24 EMTN	50	0	0	50 GBP	98.40%	54'802.62	0.01	a)
XS2111458977	0.7500 % COE 0 3/4 07/22/27	0	40	0	40 GBP	88.44%	39'403.17	0.00	a)
XS2118273866	1.0000 % SIEGR 1 02/20/25 EMTN	100	0	0	100 GBP	96.11%	107'054.52	0.01	a)
XS2121223601	0.7500 % IFC 0 3/4 07/22/27 GMTN	30	0	0	30 GBP	88.66%	29'626.23	0.00	a)
XS2122575678	1.0000 % IBRD 1 12/21/29	40	0	0	40 GBP	83.71%	37'294.87	0.00	a)
XS2147890607	2.8750 % DGELN 2 7/8 03/27/29	0	100	0	100 GBP	92.23%	102'729.43	0.01	a)
XS2154346642	2.3750 % SANCTU 2 3/8 04/14/50	0	100	0	100 GBP	59.38%	66'134.95	0.01	a)
XS2182065149	2.0000 % SVTLN 2 06/02/40 EMTN	0	100	0	100 GBP	63.44%	70'657.18	0.01	a)
XS2236022153	0.2500 % IBRD 0 1/4 09/23/27 GMTN	0	600	0	600 GBP	86.60%	578'770.72	0.06	a)
XS2243329807	0.2500 % IFC 0 1/4 12/15/25 GMTN	40	0	0	40 GBP	92.41%	41'170.63	0.00	a)
XS2262090009	0.2500 % IBRD 0 1/4 07/22/26	40	0	0	40 GBP	90.47%	40'308.07	0.00	a)
XS2281370903	0.1250 % EIB 0 1/8 12/14/26 EMTN	50	0	0	50 GBP	88.86%	49'488.43	0.01	a)
XS2297687787	0.3750 % IDAWBG 0 3/8 09/22/27	0	30	0	30 GBP	86.63%	28'947.22	0.00	a)
XS2307879721	0.5000 % BNG 0 1/2 12/21/26	100	0	0	100 GBP	89.30%	99'469.19	0.01	a)
XS2317061864	0.3750 % COE 0 3/8 12/15/25 EMTN	20	0	0	20 GBP	92.46%	20'597.79	0.00	a)
XS2318615569	0.3750 % KUNTA 0 3/8 12/17/25 EMTN	0	100	0	100 GBP	92.40%	102'919.90	0.01	a)
XS2322254322	1.5000 % GS 1 1/2 12/07/27 EMTN	0	50	0	50 GBP	87.72%	48'851.87	0.00	a)
XS2332199830	2.5000 % GATAIR 2 1/2 04/15/30 EMTN	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2332979769	0.7500 % ASIA 0 3/4 12/07/27	30	0	0	30 GBP	87.65%	29'288.73	0.00	a)
XS2345876333	0.7500 % KFW 0 3/4 12/07/27 EMTN	65	0	0	65 GBP	87.67%	63'476.29	0.01	a)
XS2355059911	1.8750 % GS 1 7/8 12/16/30 EMTN	0	50	0	50 GBP	81.47%	45'372.75	0.00	a)
XS2356217203	0.5000 % AFDB 0 1/2 06/22/26 GMTN	20	0	0	20 GBP	91.11%	20'296.61	0.00	a)
XS2365061931	0.6250 % IBRD 0 5/8 07/14/28	50	0	0	50 GBP	85.60%	47'674.52	0.00	a)
XS2385061234	1.0000 % RY 1 09/09/26 EMTN	0	500	0	500 GBP	90.77%	505'538.31	0.05	a)
XS2385755835	1.5000 % YBS 1 1/2 09/15/29 EMTN	0	100	0	100 GBP	82.89%	92'327.17	0.01	a)
XS2388161650	0.7500 % IDAWBG 0 3/4 09/21/28	30	0	0	30 GBP	85.24%	28'483.42	0.00	a)
XS2389689337	0.6250 % LBANK 0 5/8 12/15/25 EMTN	30	0	0	30 GBP	92.82%	31'015.98	0.00	a)
XS2393618389	2.3080 % ANNFND 2.308 10/06/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	77.03%	85'800.00	0.01	a)
XS2398918024	0.8750 % EIB 0 7/8 05/15/26	30	0	0	30 GBP	92.36%	30'860.93	0.00	a)
XS2405139432	2.0570 % NWG 2.057 11/09/28	100	0	0	100 GBP	88.65%	98'742.95	0.01	a)
XS2429214294	1.5000 % NYLIFE 1 1/2 07/15/27 EMTN	100	0	0	100 GBP	89.82%	100'048.39	0.01	a)
XS2430324405	1.1250 % KFW 1 1/8 07/04/25 EMTN	40	0	0	40 GBP	95.23%	42'430.18	0.00	a)
XS2430702105	2.0000 % LONQUA 2 03/31/32 EMTN	100	0	0	100 GBP	78.68%	87'634.51	0.01	a)
XS2430947049	1.1250 % ASIA 1 1/8 06/10/25	30	0	0	30 GBP	95.38%	31'871.42	0.00	a)
XS2432857048	1.1250 % NIB 1 1/8 06/18/25 EMTN	30	0	0	30 GBP	95.25%	31'828.31	0.00	a)
XS2434410051	1.1250 % AIIB 1 1/8 09/15/26	30	0	0	30 GBP	91.77%	30'665.12	0.00	a)
XS2434417494	1.2500 % DEXGRP 1 1/4 07/21/25	0	100	0	100 GBP	94.90%	105'698.96	0.01	a)
XS2441530891	1.2500 % KFW 1 1/4 07/31/26 EMTN	40	0	0	40 GBP	92.58%	41'246.82	0.00	a)
XS2507889835	2.7500 % IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN	30	0	0	30 GBP	96.92%	32'387.02	0.00	a)
XS2526505123	4.7500 % SANTAN 4 3/4 08/30/28 EMTN	100	0	0	100 GBP	97.49%	108'593.86	0.01	a)
XS2550206333	6.3750 % NWGLN 6 3/8 10/28/34 EMTN	0	100	0	100 GBP	105.16%	117'135.99	0.01	a)
XS2558389891	5.7890 % MS 5.789 11/18/33	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2573690489	4.1250 % KFW 4 1/8 02/18/26 EMTN	0	40	0	40 GBP	99.06%	44'133.48	0.00	a)
XS2583600015	3.8750 % ASIA 3 7/8 02/10/26 GMTN	0	80	0	80 GBP	98.43%	87'704.68	0.01	a)
XS2591847970	6.6250 % LLOYDS 6 5/8 06/02/33 EMTN	0	100	0	100 GBP	100.29%	111'702.62	0.01	a)
XS2592017300	6.1250 % DB 6 1/8 12/12/30 EMTN	0	100	0	100 GBP	98.93%	110'187.78	0.01	a)
XS2594034998	4.0000 % IADB 4 12/17/29 GMTN	0	60	0	60 GBP	98.33%	65'712.35	0.01	a)
XS2597544290	4.8750 % LANDLN 4 7/8 09/15/32 EMTN	0	100	0	100 GBP	99.15%	110'437.28	0.01	a)
XS2610167962	3.8750 % EIB 3 7/8 04/12/28 EMTN	0	50	0	50 GBP	98.37%	54'783.68	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2626254515	5.2500 % ABNANV 5 1/4 05/26/26 EMTN	0	100	0	100 GBP	99.97%	111'356.21	0.01	a)
XS2638381819	6.0000 % AWLN 6 06/20/39 GMTN	0	100	0	100 GBP	103.82%	115'636.74	0.01	a)
XS2649050106	4.8750 % EIB 4 7/8 12/16/30 EMTN	0	40	0	40 GBP	104.00%	46'337.12	0.00	a)
XS2669894821	6.1250 % NWDIE 6 1/8 08/21/28 EMTN	0	100	0	100 GBP	103.44%	115'216.82	0.01	a)
XS2687917018	6.5000 % VW 6 1/2 09/18/27 EMTN	0	100	0	100 GBP	102.82%	114'522.89	0.01	a)
XS2725781509	6.2500 % NBHA 6 1/4 12/06/41 EMTN	0	100	0	100 GBP	105.11%	117'079.18	0.01	a)
XS2728570834	6.0000 % O 6 12/05/39	0	100	0	100 GBP	104.45%	116'339.58	0.01	a)
GBP							38'973'051.22	3.99	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	352	0	0	352 ILS	106.11%	92'084.48	0.01	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	285	80	0	365 ILS	111.23%	100'091.74	0.01	a)
IL0011308488	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/24 0324	127	0	0	127 ILS	99.93%	31'289.63	0.00	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	320	0	0	320 ILS	97.07%	76'583.02	0.01	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	122	300	0	422 ILS	94.81%	98'641.48	0.01	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	312	100	0	412 ILS	86.76%	88'126.00	0.01	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	250	200	0	450 ILS	93.13%	103'324.36	0.01	a)
IL0011550683	1.5000 % ILGOV 1 1/2 11/30/23 1123	200	0	200	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	496	100	0	596 ILS	84.11%	123'595.19	0.01	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	129	0	0	129 ILS	96.33%	30'637.12	0.00	a)
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	250	120	0	370 ILS	70.64%	64'439.12	0.01	a)
IL0011671059	0.1500 % ILGOV 0.15 07/31/23 0723	126	0	126	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011746976	0.5000 % ILGOV 0 1/2 02/27/26 0226	210	100	0	310 ILS	93.76%	71'657.15	0.01	a)
IL0011757775	0.4000 % ILGOV 0.4 10/31/24 1024	220	0	0	220 ILS	97.95%	53'126.50	0.01	a)
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	0	300	0	300 ILS	80.60%	59'611.04	0.01	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	150	0	0	150 ILS	69.45%	25'683.50	0.00	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	0	200	0	200 ILS	99.23%	48'927.77	0.01	a)
ILS							1'067'818.10	0.11	
JP311600AP38	0.2800 % ASABRE 0.28 03/06/26 19	0	100'000	0	100'000 JPY	99.74%	586'786.58	0.06	a)
JP322860BK67	0.4050 % KANSEL 0.405 06/20/29 530	0	100'000	0	100'000 JPY	98.28%	578'232.29	0.06	a)
XS0306605956	2.8000 % C 2.8 06/25/27	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JPY							1'165'018.87	0.12	
KR10350172C8	3.0000 % KTB 3 12/10/42 4212	450'000	200'000	0	650'000 KRW	93.27%	400'877.03	0.04	a)
KR103501G935	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/24 2403	200'000	0	200'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103501GA35	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/25 2503	700'000	0	0	700'000 KRW	98.07%	453'956.21	0.05	a)
KR103501GA92	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/25 2509	650'000	550'000	0	1'200'000 KRW	96.57%	766'301.42	0.08	a)
KR103501GAC4	0.8750 % KTB 0 7/8 12/10/23 2312	400'000	0	400'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103501GB34	1.2500 % KTB 1 1/4 03/10/26 2603	700'000	200'000	0	900'000 KRW	95.80%	570'119.26	0.06	a)
KR103501GB67	1.1250 % KTB 1 1/8 06/10/24 2406	500'000	0	500'000	0 KRW	0.00%	0.00	0.00	
KR103501GB91	1.7500 % KTB 1 3/4 09/10/26 2609	450'000	300'000	0	750'000 KRW	96.00%	476'109.82	0.05	a)
KR103501GBC2	1.8750 % KTB 1 7/8 12/10/24 2412	300'000	250'000	0	550'000 KRW	98.79%	359'297.90	0.04	a)
KR103502G3C1	3.7500 % KTB 3 3/4 12/10/33 3312	400'000	0	0	400'000 KRW	102.10%	270'062.88	0.03	a)
KR103502G636	2.0000 % KTB 2 03/10/46 4603	200'000	300'000	0	500'000 KRW	78.11%	258'265.43	0.03	a)
KR103502G693	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/36 3609	400'000	0	0	400'000 KRW	80.00%	211'593.73	0.02	a)
KR103502G6C4	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/26 2612	300'000	450'000	0	750'000 KRW	94.90%	470'664.04	0.05	a)
KR103502G735	2.1250 % KTB 2 1/8 03/10/47 4703	450'000	0	0	450'000 KRW	79.45%	236'420.20	0.02	a)
KR103502G768	2.1250 % KTB 2 1/8 06/10/27 2706	550'000	350'000	0	900'000 KRW	95.96%	571'085.61	0.06	a)
KR103502G7C2	2.3750 % KTB 2 3/8 12/10/27 2712	400'000	550'000	0	950'000 KRW	96.28%	604'814.51	0.06	a)
KR103502G867	2.6250 % KTB 2 5/8 06/10/28 2806	400'000	350'000	0	750'000 KRW	96.70%	479'576.43	0.05	a)
KR103502G933	2.0000 % KTB 2 03/10/49 4903	300'000	400'000	0	700'000 KRW	76.75%	355'267.05	0.04	a)
KR103502G966	1.8750 % KTB 1 7/8 06/10/29 2906	300'000	250'000	0	550'000 KRW	92.32%	335'762.97	0.03	a)
KR103502G990	1.1250 % KTB 1 1/8 09/10/39 3909	300'000	300'000	0	600'000 KRW	72.19%	286'408.23	0.03	a)
KR103502G9C8	1.3750 % KTB 1 3/8 12/10/29 2912	300'000	300'000	0	600'000 KRW	89.11%	353'553.41	0.04	a)
KR103502GA34	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/50 5003	850'000	0	0	850'000 KRW	70.38%	395'609.59	0.04	a)
KR103502GA67	1.3750 % KTB 1 3/8 06/10/30 3006	600'000	0	0	600'000 KRW	88.10%	349'565.96	0.04	a)
KR103502GA91	1.5000 % KTB 1 1/2 09/10/40 4009	300'000	0	0	300'000 KRW	75.42%	149'621.35	0.02	a)
KR103502GAC2	1.5000 % KTB 1 1/2 12/10/30 3012	500'000	250'000	0	750'000 KRW	87.98%	436'324.29	0.04	a)
KR103502GB33	1.8750 % KTB 1 7/8 03/10/51 5103	600'000	300'000	0	900'000 KRW	74.05%	440'679.65	0.05	a)
KR103502GBC0	2.3750 % KTB 2 3/8 12/10/31 3112	500'000	200'000	0	700'000 KRW	92.31%	427'294.62	0.04	a)
KR103502GC32	2.5000 % KTB 2 1/2 03/10/52 5203	0	300'000	0	300'000 KRW	83.64%	165'925.24	0.02	a)
KR103502GC65	3.3750 % KTB 3 3/8 06/10/32 3206	300'000	250'000	0	550'000 KRW	98.95%	359'872.66	0.04	a)
KR103502GC99	3.1250 % KTB 3 1/8 09/10/52 5209	300'000	0	0	300'000 KRW	94.90%	188'268.23	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
KR103502GD31	3.2500 % KTB 3 1/4 03/10/53 5303	0	1'050'000	0	1'050'000	KRW 97.51%	677'046.58	0.07	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	0	550'000	0	550'000	KRW 97.91%	356'081.70	0.04	a)
KR103505GC96	3.5000 % KTB 3 1/2 09/10/2072 7209	0	250'000	0	250'000	KRW 103.61%	171'290.68	0.02	a)
KRW							11'577'716.68	1.18	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	21'810	0	21'810	0	MXN 0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	26'970	10'000	0	36'970	MXN 99.27%	189'357.02	0.02	a)
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	4'000	8'000	0	12'000	MXN 106.33%	65'834.07	0.01	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	57'330	0	0	57'330	MXN 94.51%	279'556.28	0.03	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	27'370	22'000	0	49'370	MXN 97.26%	247'735.98	0.03	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	36'530	0	0	36'530	MXN 94.23%	177'598.46	0.02	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	62'440	13'000	0	75'440	MXN 92.54%	360'197.53	0.04	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	36'790	16'000	0	52'790	MXN 86.36%	235'227.96	0.02	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	14'000	0	0	14'000	MXN 90.35%	65'263.53	0.01	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	76'050	0	0	76'050	MXN 92.48%	362'886.39	0.04	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	37'390	10'000	0	47'390	MXN 87.57%	214'124.56	0.02	a)
MX0MGO000151	8.0000 % MBONO 8 09/05/24 M	23'370	0	23'370	0	MXN 0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	0	20'000	0	20'000	MXN 93.94%	96'941.25	0.01	a)
MX0MGO000180	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	15'000	15'000	0	30'000	MXN 95.19%	147'345.14	0.02	a)
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	16'000	47'000	0	63'000	MXN 89.73%	291'654.32	0.03	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	15'000	16'000	0	31'000	MXN 89.70%	143'474.05	0.01	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	13'000	17'000	0	30'000	MXN 86.79%	134'340.05	0.01	a)
MX0MGO0001F1	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	0	10'000	0	10'000	MXN 97.00%	50'048.92	0.01	a)
MXM5GO000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 M5	0	13'000	0	13'000	MXN 91.32%	61'252.46	0.01	a)
MXN							3'122'837.97	0.32	
NO0010646813	2.0000 % NGB 2 05/24/23 475	294	0	294	0	NOK 0.00%	0.00	0.00	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	795	0	0	795	NOK 99.95%	66'010.92	0.01	a)
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	300	0	0	300	NOK 97.39%	24'272.00	0.00	a)
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	323	500	0	823	NOK 95.22%	65'102.51	0.01	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	600	0	0	600	NOK 94.00%	46'855.22	0.00	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	290	400	0	690	NOK 93.08%	53'353.27	0.01	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	600	0	0	600	NOK 90.04%	44'880.82	0.00	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	359	500	0	859	NOK 86.38%	61'642.49	0.01	a)
NO0010907033	1.3200 % OSLO 1.32 02/16/28	1'000	0	0	1'000	NOK 88.20%	73'272.76	0.01	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	213	850	0	1'063	NOK 83.42%	73'669.47	0.01	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	150	0	0	150	NOK 88.14%	10'983.06	0.00	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	0	450	0	450	NOK 99.09%	37'043.16	0.00	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	800	0	800	NOK 93.76%	62'313.45	0.01	a)
X51185971923	1.5000 % NIB 1 1/2 03/13/25 EMTN	500	0	0	500	NOK 96.89%	40'247.30	0.00	a)
X51967658243	1.6250 % KFW 1 5/8 04/03/24 EMTN	500	0	0	500	NOK 99.74%	41'428.24	0.00	a)
NOK							701'074.67	0.07	
NZADBDT007C4	3.5000 % ASIA 3 1/2 05/30/24 MTN	60	0	0	60	NZD 99.47%	32'016.62	0.00	a)
NZGOVDT423C0	5.5000 % NZGB 5 1/2 04/15/23 0423	90	0	90	0	NZD 0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	141	0	0	141	NZD 97.26%	73'571.13	0.01	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	159	0	0	159	NZD 99.59%	84'952.37	0.01	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	142	0	0	142	NZD 92.91%	70'780.62	0.01	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	102	0	0	102	NZD 91.08%	49'838.30	0.01	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	107	0	0	107	NZD 79.49%	45'631.24	0.00	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	76	0	0	76	NZD 99.02%	40'370.91	0.00	a)
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	40	0	0	40	NZD 91.15%	19'559.02	0.00	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	30	0	0	30	NZD 83.65%	13'462.68	0.00	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	112	1'500	0	1'612	NZD 81.04%	700'858.12	0.07	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	60	0	0	60	NZD 81.98%	26'388.46	0.00	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	38	0	0	38	NZD 63.07%	12'856.46	0.00	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	70	0	0	70	NZD 67.31%	25'277.47	0.00	a)
NZHND0001L7	2.2470 % HOUSNZ 2.247 10/05/26	50	0	0	50	NZD 93.23%	25'006.98	0.00	a)
NZHND0230L2	2.1830 % HOUSNZ 2.183 04/24/30 MTN	60	0	0	60	NZD 84.72%	27'268.49	0.00	a)
NZIBDDT019C1	2.8750 % IBRD 2 7/8 11/30/26 MTN	0	600	0	600	NZD 94.77%	305'044.03	0.03	a)
NZLGFDT007C4	4.5000 % NZLGFA 4 1/2 04/15/27	50	0	0	50	NZD 98.39%	26'392.70	0.00	a)
NZLGFDT008C2	2.7500 % NZLGFA 2 3/4 04/15/25	50	0	0	50	NZD 96.91%	25'995.71	0.00	a)
NZLGFDT009C0	3.5000 % NZLGFA 3 1/2 04/14/33	50	0	0	50	NZD 86.93%	23'318.96	0.00	a)
NZLGFDT011C6	2.2500 % NZLGFA 2 1/4 04/15/24	50	0	0	50	NZD 99.62%	26'722.90	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NZLGFDT012C4	1.5000 % NZLGFA 1 1/2 04/20/29	50	0	0	50 NZD	84.24%	22'595.79	0.00	a)
NZLGFDT014C0	1.5000 % NZLGFA 1 1/2 04/15/26	60	0	0	60 NZD	92.63%	29'815.57	0.00	a)
NZLGFDT018C1	2.2500 % NZLGFA 2 1/4 05/15/28	50	0	0	50 NZD	89.68%	24'054.20	0.00	a)
NZWNZD0226L9	1.4390 % WSTPNZ 1.439 02/24/26 MTN	50	0	0	50 NZD	92.56%	24'827.53	0.00	a)
NZD							1'756'606.26	0.18	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	0	600	0	600 PLN	91.46%	121'170.52	0.01	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	1'000	500	0	1'500 PLN	92.16%	305'234.82	0.03	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	180	0	0	180 PLN	88.56%	35'199.74	0.00	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	1'000	0	0	1'000 PLN	95.34%	210'504.87	0.02	a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	1'370	500	0	1'870 PLN	78.45%	323'904.25	0.03	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	1'450	0	0	1'450 PLN	88.37%	282'941.97	0.03	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	400	700	0	1'100 PLN	77.26%	187'651.28	0.02	a)
PL0000114021	0.0000 % POLGB 0 07/25/24 0724	700	0	0	700 PLN	98.19%	151'761.57	0.02	a)
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	900	0	0	900 PLN	92.19%	183'202.49	0.02	a)
PLN							1'801'571.51	0.18	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	455	0	0	455 SEK	110.55%	42'802.70	0.00	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	690	200	0	890 SEK	98.39%	74'518.08	0.01	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	955	0	955	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	720	700	0	1'420 SEK	99.11%	119'762.85	0.01	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	885	400	0	1'285 SEK	95.41%	104'336.42	0.01	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	415	850	0	1'265 SEK	92.80%	99'896.40	0.01	a)
SE0010948240	1.0000 % KOMINS 1 11/13/23 #2311 2311	800	0	800	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0011089622	1.0000 % SWEDA 1 12/20/23 #193 193	600	0	600	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	860	600	0	1'460 SEK	90.84%	112'859.03	0.01	a)
SE0011309244	1.2500 % LFBANK 1 1/4 09/17/25 #518 518	800	800	0	1'600 SEK	96.45%	131'318.19	0.01	a)
SE0011414010	1.0000 % KOMINS 1 05/12/25 #2505 2505	500	0	0	500 SEK	96.93%	41'241.60	0.00	a)
SE0012142206	1.0000 % SWEDA 1 09/18/24 #194 194	1'100	0	0	1'100 SEK	98.38%	92'088.83	0.01	a)
SE0012230415	1.0000 % NDAFH 1 09/18/24 #5534 5534	1'500	0	0	1'500 SEK	98.38%	125'575.67	0.01	a)
SE0012324341	1.5000 % LFBANK 1 1/2 09/16/26 #519 519	1'300	0	0	1'300 SEK	95.40%	105'536.65	0.01	a)
SE0012569572	1.0000 % KOMINS 1 11/12/26 #2611 2611	500	0	0	500 SEK	94.21%	40'085.11	0.00	a)
SE0013358413	1.0000 % NDAFH 1 09/17/25 #5535 5535	700	0	0	700 SEK	96.08%	57'235.47	0.01	a)
SE0013358439	0.5000 % NDAFH 0 1/2 09/16/26 #5536 5536	1'600	0	0	1'600 SEK	93.03%	126'661.61	0.01	a)
SE0013358447	1.0000 % NDAFH 1 06/16/27 #5537 5537	2'000	0	0	2'000 SEK	92.80%	157'945.77	0.02	a)
SE0013381571	0.5000 % SBAB 0 1/2 06/11/25 #146 146	2'000	0	0	2'000 SEK	96.06%	163'485.67	0.02	a)
SE0013546066	1.0000 % SWEDA 1 06/18/25 #195 195	900	0	0	900 SEK	96.60%	73'985.96	0.01	a)
SE0013745452	0.7500 % KOMINS 0 3/4 02/04/26 #2602 2602	600	0	0	600 SEK	95.12%	48'565.75	0.00	a)
SE0013877214	1.0000 % DANBNK 1 12/17/25 #2512 2512	2'000	0	0	2'000 SEK	95.59%	162'690.85	0.02	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	300	700	0	1'000 SEK	84.79%	72'156.52	0.01	a)
SE0014694659	1.0000 % LFBANK 1 09/15/27 #520 520	500	1'000	0	1'500 SEK	92.36%	117'890.02	0.01	a)
SE0015193313	0.5000 % SGB 0 1/2 11/24/45 #1063 1063	300	0	0	300 SEK	64.47%	16'459.62	0.00	a)
SE0015243415	0.2500 % SBAB 0 1/4 06/09/27 #148 148	0	2'000	0	2'000 SEK	90.57%	154'145.29	0.02	a)
SE0015244991	1.0000 % SWEDA 1 03/18/26 #196 196	500	0	0	500 SEK	95.16%	40'488.90	0.00	a)
SE0015503446	0.5000 % LFBANK 0 1/2 09/20/28 #521 521	800	0	0	800 SEK	88.20%	60'043.97	0.01	a)
SE0015660139	0.7500 % KOMINS 0 3/4 05/12/28 #2805 2805	400	0	0	400 SEK	90.57%	30'827.70	0.00	a)
SE0015987540	0.5000 % DANBNK 0 1/2 12/16/26 #2612 2612	0	2'000	0	2'000 SEK	92.41%	157'278.60	0.02	a)
SE0016102115	1.3750 % SGB 1 3/8 06/23/2071 #1064 1064	0	400	0	400 SEK	59.94%	20'402.48	0.00	a)
SE0016828529	1.0000 % SWEDA 1 03/17/27 #197 197	700	900	0	1'600 SEK	93.27%	126'996.56	0.01	a)
SE0016829048	0.5000 % KOMINS 0 1/2 06/15/27 #2706 2706	500	0	0	500 SEK	91.64%	38'989.90	0.00	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	700	0	700 SEK	93.71%	55'821.31	0.01	a)
SE0019072042	3.5000 % SBAB 3 1/2 06/14/28 #149 149	2'000	0	0	2'000 SEK	100.71%	171'401.51	0.02	a)
SE0019175548	3.0000 % SWEDA 3 03/15/28 #198 198	0	1'200	0	1'200 SEK	98.82%	100'909.86	0.01	a)
XS1171476143	1.2500 % EIB 1 1/4 05/12/25 EMTN	500	0	0	500 SEK	97.12%	41'324.14	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
X51347679448	1.7500 % EIB 1 3/4 11/12/26 EMTN	500	0	0	500 SEK	96.08%	40'882.48	0.00	a)
SEK							3'126'611.47	0.32	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	45	120	0	165 SGD	98.64%	106'583.29	0.01	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	87	50	0	137 SGD	95.12%	85'336.55	0.01	a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	113	0	0	113 SGD	97.55%	72'191.23	0.01	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	166	0	0	166 SGD	91.27%	99'222.76	0.01	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	70	0	0	70 SGD	98.34%	45'078.71	0.00	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	100	60	0	160 SGD	95.88%	100'463.64	0.01	a)
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	31	0	31	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	74	80	0	154 SGD	102.34%	103'207.22	0.01	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	150	0	0	150 SGD	98.88%	97'129.65	0.01	a)
SG60F4000001	3.9480 % HDBSP 3.948 01/29/29 MTN	0	250	0	250 SGD	102.76%	168'239.99	0.02	a)
SG7160932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	110	60	0	170 SGD	101.08%	112'527.30	0.01	a)
SG7530941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	133	0	0	133 SGD	99.65%	86'795.77	0.01	a)
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	115	70	0	185 SGD	98.66%	119'525.49	0.01	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	90	70	0	160 SGD	95.11%	99'657.88	0.01	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	20	60	0	80 SGD	91.18%	47'769.48	0.00	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	118	0	0	118 SGD	78.90%	60'970.52	0.01	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	80	0	0	80 SGD	95.37%	49'963.58	0.01	a)
SGXF33080817	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/27	80	0	0	80 SGD	99.33%	52'038.24	0.01	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	110	0	0	110 SGD	96.56%	69'560.04	0.01	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	50	65	0	115 SGD	100.04%	75'340.43	0.01	a)
SGXF51035222	2.8750 % SIGB 2 7/8 08/01/28	0	60	0	60 SGD	99.36%	39'042.04	0.00	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	50	80	0	130 SGD	90.35%	76'920.49	0.01	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	40	60	0	100 SGD	79.20%	51'865.74	0.01	a)
SGXF92110679	2.0000 % SIGB 2 02/01/24	60	0	60	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SGXF98985447	1.2650 % HDBSP 1.265 06/24/30 MTN	0	250	0	250 SGD	88.47%	144'834.63	0.01	a)
SGD							1'964'264.67	0.20	
TH0623034608	0.7500 % THAIGB 0 3/4 06/17/24	3'500	0	0	3'500 THB	99.56%	85'554.89	0.01	a)
TH0623035605	0.9500 % THAIGB 0.95 06/17/25	4'500	0	0	4'500 THB	98.46%	108'786.04	0.01	a)
TH0623035C07	3.8500 % THAIGB 3.85 12/12/25	2'500	0	0	2'500 THB	102.97%	63'203.06	0.01	a)
TH0623036603	2.3500 % THAIGB 2.35 06/17/26	0	3'000	0	3'000 THB	100.46%	73'991.24	0.01	a)
TH0623036C06	2.1250 % THAIGB 2 1/8 12/17/26	4'000	4'000	0	8'000 THB	99.91%	196'241.48	0.02	a)
TH0623037601	1.0000 % THAIGB 1 06/17/27	6'000	0	0	6'000 THB	96.24%	141'770.38	0.01	a)
TH0623038609	2.6500 % THAIGB 2.65 06/17/28	4'000	0	0	4'000 THB	101.67%	99'844.27	0.01	a)
TH0623038C04	2.8750 % THAIGB 2 7/8 12/17/28	4'000	0	0	4'000 THB	102.89%	101'044.36	0.01	a)
TH0623039C03	1.6000 % THAIGB 1.6 12/17/29	2'000	5'500	0	7'500 THB	96.31%	177'349.24	0.02	a)
TH062303D603	3.3500 % THAIGB 3.35 06/17/33	0	5'000	0	5'000 THB	106.46%	130'691.63	0.01	a)
TH062303FC01	1.5850 % THAIGB 1.585 12/17/35	6'000	0	0	6'000 THB	89.51%	131'862.26	0.01	a)
TH062303G606	3.4000 % THAIGB 3.4 06/17/36	2'000	0	0	2'000 THB	106.85%	52'464.72	0.01	a)
TH062303HC09	4.2600 % THAIGB 4.26 12/12/37	3'900	0	0	3'900 THB	113.50%	108'674.67	0.01	a)
TH062303I602	3.3000 % THAIGB 3.3 06/17/38	5'500	0	0	5'500 THB	105.63%	142'640.01	0.01	a)
TH062303M604	2.0000 % THAIGB 2 06/17/42	7'500	0	0	7'500 THB	86.72%	159'688.52	0.02	a)
TH062303Q605	2.8750 % THAIGB 2 7/8 06/17/46	9'500	0	0	9'500 THB	96.48%	225'036.55	0.02	a)
TH0623A33C00	2.4000 % THAIGB 2.4 12/17/23	2'000	0	2'000	0 THB	0.00%	0.00	0.00	
TH0623A34C09	1.4500 % THAIGB 1.45 12/17/24	4'000	0	0	4'000 THB	99.35%	97'567.83	0.01	a)
TH0623A3B608	3.6500 % THAIGB 3.65 06/20/31	5'000	0	0	5'000 THB	108.33%	132'978.63	0.01	a)
TH0623A3C606	3.7750 % THAIGB 3.775 06/25/32	5'000	0	0	5'000 THB	109.73%	134'704.62	0.01	a)
TH0623X32600	2.7500 % THAIGB 2 3/4 06/17/52 THAI	0	12'000	0	12'000 THB	89.75%	264'408.05	0.03	a)
TH0623X38C03	2.0000 % THAIGB 2 12/17/31	4'500	0	0	4'500 THB	96.97%	107'132.10	0.01	a)
TH0623X3T603	1.8750 % THAIGB 1 7/8 06/17/49	5'000	0	0	5'000 THB	76.46%	93'857.81	0.01	a)
THB							2'829'492.36	0.29	
DE000LB2ZTL3	2.0000 % LBBW 2 02/24/25 EMTN	70	0	0	70 USD	96.64%	59'567.45	0.01	a)
FR001400CRX1	4.0000 % AGFRNC 4 09/21/27 EMTN	200	0	0	200 USD	97.69%	172'043.62	0.02	a)
FR001400F638	4.2500 % CDCEPS 4 1/4 01/20/26	200	0	0	200 USD	98.85%	174'081.21	0.02	a)
HK0000789823	1.7500 % HKINTL 1 3/4 11/24/31 GMTN	200	0	0	200 USD	82.89%	145'977.58	0.01	a)
US003865AB88	6.5000 % TAQAUIH 6 1/2 10/27/36 144A	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00828EDC03	3.0000 % AFDB 3 09/20/23	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US00828EEE59	0.8750 % AFDB 0 7/8 03/23/26 GDIF	50	50	0	100 USD	92.56%	81'507.23	0.01	a)
US00828EEP07	4.3750 % AFDB 4 3/8 11/03/27 GMTN	80	0	0	80 USD	99.65%	70'195.33	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US00828EY14	4.6250 % AFDB 4 5/8 01/04/27	0	80	0	80 USD	100.19%	70'575.73	0.01	a)
US00828EEZ88	4.1250 % AFDB 4 1/8 02/25/27	0	60	0	60 USD	98.86%	52'232.29	0.01	a)
US00946AAD63	2.5000 % HKAA 2 1/2 01/12/32 144A	200	0	0	200 USD	85.44%	150'475.43	0.02	a)
US013051EA13	3.3000 % ALTA 3.3 03/15/28	0	50	0	50 USD	95.24%	41'929.59	0.00	a)
US013051EF00	2.9500 % ALTA 2.95 01/23/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US013051EK94	1.0000 % ALTA 1 05/20/25	50	0	0	50 USD	95.21%	41'920.34	0.00	a)
US013051EM50	1.3000 % ALTA 1.3 07/22/30	50	0	0	50 USD	82.04%	36'120.60	0.00	a)
US045167EG44	2.7500 % ASIA 2 3/4 01/19/28 GMTN	60	0	0	60 USD	93.97%	49'645.59	0.01	a)
US045167EP43	1.7500 % ASIA 1 3/4 09/19/29 GMTN	50	0	0	50 USD	87.08%	38'336.95	0.00	a)
US045167EQ26	1.5000 % ASIA 1 1/2 10/18/24	50	0	0	50 USD	97.67%	43'002.54	0.00	a)
US045167ER09	1.8750 % ASIA 1 7/8 01/24/30 GMTN	70	0	0	70 USD	86.86%	53'537.35	0.01	a)
US045167EU38	0.6250 % ASIA 0 5/8 04/29/25	100	0	0	100 USD	95.09%	83'733.26	0.01	a)
US045167EW93	0.3750 % ASIA 0 3/8 09/03/25 GMTN	60	0	0	60 USD	93.53%	49'413.65	0.01	a)
US045167EX76	0.2500 % ASIA 0 1/4 10/06/23 GMTN	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US045167EZ25	0.5000 % ASIA 0 1/2 02/04/26 GMTN	100	0	0	100 USD	92.32%	81'288.85	0.01	a)
US045167FB48	1.5000 % ASIA 1 1/2 03/04/31 GMTN	50	0	0	50 USD	82.74%	36'429.23	0.00	a)
US045167FC21	1.0000 % ASIA 1 04/14/26 GMTN	70	50	0	120 USD	92.67%	97'920.68	0.01	a)
US045167FE86	0.3750 % ASIA 0 3/8 06/11/24 GMTN	80	0	0	80 USD	98.65%	69'494.41	0.01	a)
US045167FF51	1.2500 % ASIA 1 1/4 06/09/28 GMTN	50	0	0	50 USD	87.76%	38'636.33	0.00	a)
US045167FG35	0.6250 % ASIA 0 5/8 10/08/24 GMTN	50	0	0	50 USD	97.27%	42'824.23	0.00	a)
US045167FH18	1.5000 % ASIA 1 1/2 01/20/27 GMTN	100	0	0	100 USD	91.92%	80'942.80	0.01	a)
US045167FP34	3.1250 % ASIA 3 1/8 08/20/27 GMTN	60	50	0	110 USD	95.69%	92'684.84	0.01	a)
US045167FV02	4.0000 % ASIA 4 01/12/33 GMTN	70	0	0	70 USD	97.00%	59'789.96	0.01	a)
US045167FW84	3.7500 % ASIA 3 3/4 04/25/28 GMTN	0	60	0	60 USD	97.42%	51'469.38	0.01	a)
US045167FZ16	4.5000 % ASIA 4 1/2 08/25/28 GMTN	0	70	0	70 USD	100.46%	61'921.42	0.01	a)
US045167GB39	4.1250 % ASIA 4 1/8 01/12/34 GMTN	0	50	0	50 USD	97.77%	43'044.37	0.00	a)
US04517PBT84	3.8750 % ASIA 3 7/8 06/14/33 GMTN	0	50	0	50 USD	95.94%	42'241.74	0.00	a)
US04517PBU57	4.6250 % ASIA 4 5/8 06/13/25 GMTN	0	50	0	50 USD	99.54%	43'824.53	0.00	a)
US04522KAB26	0.5000 % AIIB 0 1/2 05/28/25	0	60	0	60 USD	94.56%	49'956.24	0.01	a)
US04522KAC09	0.2500 % AIIB 0 1/4 09/29/23	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US04522KAD81	0.5000 % AIIB 0 1/2 01/27/26	50	60	0	110 USD	92.28%	89'383.84	0.01	a)
US04522KAJ51	4.0000 % AIIB 4 01/18/28	50	0	0	50 USD	98.09%	43'185.69	0.00	a)
US04522KAL08	4.1250 % AIIB 4 1/8 01/18/29	0	80	0	80 USD	98.76%	69'568.38	0.01	a)
US05591FZJ83	0.5000 % BNG 0 1/2 11/24/25 144A	200	0	0	200 USD	92.81%	163'442.41	0.02	a)
US06418BAB45	2.1700 % BNS 2.17 03/09/27 144A	0	250	0	250 USD	92.43%	203'470.89	0.02	a)
US110709AD48	1.7500 % BRCOL 1 3/4 09/27/24 10	40	0	0	40 USD	97.97%	34'506.29	0.00	a)
US110709AE21	1.3000 % BRCOL 1.3 01/29/31	0	50	0	50 USD	81.07%	35'693.97	0.00	a)
US110709AH51	0.9000 % BRCOL 0.9 07/20/26	60	0	0	60 USD	91.50%	48'342.20	0.00	a)
US110709AJ18	4.8000 % BRCOL 4.8 11/15/28	0	50	0	50 USD	101.16%	44'539.10	0.00	a)
US11070TAM09	4.2000 % BRCOL 4.2 07/06/33	0	50	0	50 USD	96.63%	42'545.53	0.00	a)
US125094AU63	0.8750 % CADEPO 0 7/8 06/10/25 144A	250	0	0	250 USD	94.83%	208'749.79	0.02	a)
US12625GAF19	2.8750 % CNOOC 2 7/8 09/30/29	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12802D2C95	1.3750 % CADES 1 3/8 01/20/31 144A	200	0	0	200 USD	81.42%	143'385.24	0.01	a)
US12802D2E51	0.3750 % CADES 0 3/8 05/27/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US12802D2L94	4.0000 % CADES 4 01/25/26 144A	200	0	0	200 USD	98.54%	173'535.27	0.02	a)
US12802D2N50	4.8750 % CADES 4 7/8 09/19/26 144A	0	200	0	200 USD	100.54%	177'060.99	0.02	a)
US12802D2P09	4.2500 % CADES 4 1/4 01/24/27 144A	0	200	0	200 USD	99.12%	174'565.52	0.02	a)
US13063A5E03	7.5000 % 13063A5E0	100	0	0	100 USD	117.69%	103'628.72	0.01	a)
US13063A5G50	7.5000 % 13063A5G5	100	0	0	100 USD	121.51%	106'991.72	0.01	a)
US13063BJC72	7.6000 % 13063BJC7	100	0	0	100 USD	123.71%	108'936.01	0.01	a)
US13063D3R79	6.0000 % 13063D3R7	0	200	0	200 USD	107.56%	189'427.44	0.02	a)
US13063D7E21	5.7500 % 13063D7E2	0	100	0	100 USD	105.97%	93'310.47	0.01	a)
US135087K787	1.6250 % CANADA 1 5/8 01/22/25	50	0	0	50 USD	96.99%	42'704.03	0.00	a)
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	60	0	0	60 USD	97.61%	51'570.82	0.01	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	0	80	0	80 USD	97.50%	68'681.49	0.01	a)
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	0	200	0	200 USD	72.46%	127'616.35	0.01	a)
US168863DP09	2.4500 % CHILE 2.45 01/31/31	200	0	0	200 USD	85.02%	149'735.77	0.02	a)
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	200	0	0	200 USD	73.34%	129'160.84	0.01	a)
US20271AAL17	5.0710 % CBAAU 5.071 09/14/28 144A	0	250	0	250 USD	100.69%	221'647.64	0.02	a)
US219868CD67	1.6250 % CAF 1 5/8 09/23/25	70	0	0	70 USD	94.36%	58'159.62	0.01	a)
US219868CF16	2.2500 % CAF 2 1/4 02/08/27	50	0	0	50 USD	91.98%	40'494.29	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US21987BAL27	6.1500 % CDEL 6.15 10/24/36 144A	100	0	0	100 USD	99.57%	87'673.72	0.01	a)
US222213AS92	2.5000 % COE 2 1/2 02/27/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US222213AY60	0.8750 % COE 0 7/8 09/22/26	50	0	0	50 USD	91.09%	40'103.33	0.00	a)
US222213BA75	3.0000 % COE 3 06/16/25	0	50	0	50 USD	97.46%	42'910.52	0.00	a)
US222213BB58	3.6250 % COE 3 5/8 01/26/28	0	50	0	50 USD	97.06%	42'733.97	0.00	a)
US22411VAU26	0.8750 % CPPIBC 0 7/8 09/09/26 144A	250	0	0	250 USD	91.04%	200'404.37	0.02	a)
US23330JAA97	6.8500 % DPWDU 6.85 07/02/37 144A	0	150	0	150 USD	108.17%	142'871.00	0.01	a)
US23503CAN74	4.5070 % 23503CAN7	100	0	0	100 USD	90.70%	79'866.94	0.01	a)
US25159MBA45	1.0000 % DBJJP 1 08/27/30 144A	0	200	0	200 USD	79.66%	140'287.46	0.01	a)
US25159MBD83	1.2500 % DBJJP 1 1/4 10/20/26 144A	200	0	0	200 USD	91.14%	160'513.70	0.02	a)
US268317AE47	5.6000 % EDF 5.6 01/27/40 144A	80	0	0	80 USD	96.84%	68'219.38	0.01	a)
US268317AT16	5.0000 % EDF 5 09/21/48 144A	0	200	0	200 USD	87.62%	154'304.06	0.02	a)
US268317AU88	4.5000 % EDF 4 1/2 09/21/28 144A	0	200	0	200 USD	96.83%	170'530.84	0.02	a)
US29446MAB81	3.6250 % EQNR 3 5/8 09/10/28	60	0	0	60 USD	95.64%	50'527.90	0.01	a)
US29446MAD48	2.8750 % EQNR 2 7/8 04/06/25	0	50	0	50 USD	97.64%	42'989.77	0.00	a)
US29446MAH51	3.7000 % EQNR 3.7 04/06/50	50	50	0	100 USD	77.90%	68'590.44	0.01	a)
US29446MAK80	2.3750 % EQNR 2 3/8 05/22/30	50	0	0	50 USD	86.91%	38'265.62	0.00	a)
US29874QEE08	1.5000 % EBRD 1 1/2 02/13/25 GMTN	50	0	0	50 USD	96.67%	42'560.94	0.00	a)
US29874QEG55	0.5000 % EBRD 0 1/2 05/19/25	50	0	0	50 USD	94.72%	41'702.41	0.00	a)
US29874QEL41	0.5000 % EBRD 0 1/2 11/25/25 GMTN	0	30	0	30 USD	92.91%	24'543.04	0.00	a)
US29874QEM24	0.5000 % EBRD 0 1/2 01/28/26 GMTN	50	0	0	50 USD	92.37%	40'669.08	0.00	a)
US29874QEX88	4.3750 % EBRD 4 3/8 03/09/28 GMTN	0	40	0	40 USD	99.74%	35'129.01	0.00	a)
US29874QFA76	4.1250 % EBRD 4 1/8 01/25/29	0	80	0	80 USD	98.87%	69'645.17	0.01	a)
US298785GS94	1.8750 % EIB 1 7/8 02/10/25	0	250	0	250 USD	97.07%	213'683.07	0.02	a)
US298785HV15	2.6250 % EIB 2 5/8 03/15/24	70	0	70	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JB33	1.6250 % EIB 1 5/8 03/14/25	50	0	0	50 USD	96.58%	42'520.88	0.00	a)
US298785JD98	0.6250 % EIB 0 5/8 07/25/25	50	50	0	100 USD	94.30%	83'033.22	0.01	a)
US298785JE71	0.8750 % EIB 0 7/8 05/17/30	50	0	0	50 USD	81.14%	35'725.67	0.00	a)
US298785JF47	0.2500 % EIB 0 1/4 09/15/23	70	0	70	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JG20	0.3750 % EIB 0 3/8 12/15/25	0	60	0	60 USD	92.56%	48'904.34	0.01	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	60	60	0	120 USD	91.67%	96'868.25	0.01	a)
US298785JL15	1.2500 % EIB 1 1/4 02/14/31	100	0	0	100 USD	81.74%	71'973.52	0.01	a)
US298785JP29	0.7500 % EIB 0 3/4 10/26/26	40	0	0	40 USD	90.66%	31'933.32	0.00	a)
US298785JQ02	1.3750 % EIB 1 3/8 03/15/27 GMTN	100	50	0	150 USD	91.28%	120'558.30	0.01	a)
US298785JS67	2.7500 % EIB 2 3/4 08/15/25	70	0	0	70 USD	97.04%	59'815.23	0.01	a)
US298785JT41	3.2500 % EIB 3 1/4 11/15/27	90	0	0	90 USD	95.96%	76'049.41	0.01	a)
US298785JU14	3.8750 % EIB 3 7/8 03/15/28	120	0	0	120 USD	98.02%	103'572.76	0.01	a)
US298785JV96	3.7500 % EIB 3 3/4 02/14/33	0	140	0	140 USD	95.55%	117'786.24	0.01	a)
US298785JW79	3.6250 % EIB 3 5/8 07/15/30	0	70	0	70 USD	95.92%	59'123.65	0.01	a)
US298785JY36	4.5000 % EIB 4 1/2 10/16/28	0	60	0	60 USD	100.55%	53'125.69	0.01	a)
US29881WAD48	0.3750 % ESM 0 3/8 09/10/25 144A	200	0	0	200 USD	93.48%	164'618.82	0.02	a)
US302154DM88	1.6250 % EIBKOR 1 5/8 01/18/27	200	0	0	200 USD	91.31%	160'799.00	0.02	a)
US302154DW60	5.1250 % EIBKOR 5 1/8 01/11/33	0	200	0	200 USD	101.53%	178'802.72	0.02	a)
US30216BHH87	2.6250 % EDC 2 5/8 02/21/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BJR42	3.0000 % EDC 3 05/25/27	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BJW37	3.8750 % EDC 3 7/8 02/14/28	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BKB70	4.3750 % EDC 4 3/8 06/29/26	0	50	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130A2UW45	2.8750 % FHLB 2 7/8 09/13/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130A3DU54	3.0000 % FHLB 3 03/12/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130A3GE85	2.7500 % FHLB 2 3/4 12/13/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130A4CH36	2.3750 % FHLB 2 3/8 03/14/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130AFFX04	3.2500 % FHLB 3 1/4 11/16/28	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130AJHU68	0.5000 % FHLB 0 1/2 04/14/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130AK5E22	0.3750 % FHLB 0 3/8 09/04/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130ALGJ78	1.0000 % FHLB 1 03/23/26	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130ALGJ78XXX	1.0000 % FHLB 1 03/23/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130AQF655	1.2500 % FHLB 1 1/4 12/21/26	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130ASME60	3.0000 % FHLB 3 07/08/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130ATT312	4.5000 % FHLB 4 1/2 10/03/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130ATUS48	4.2500 % FHLB 4 1/4 12/10/27	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3130AV7L02	5.0000 % FHLB 5 02/28/25	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US3130AWN632	4.0000 % FHLB 4 06/30/28	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3133EMRZ77	0.2500 % FFCB 0 1/4 02/26/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3133ENEJ55	0.8750 % FFCB 0 7/8 11/18/24	100	0	0	100 USD	96.93%	85'354.35	0.01	a)
US3133ENJ841	3.3750 % FFCB 3 3/8 08/26/24	100	0	0	100 USD	99.04%	87'208.79	0.01	a)
US3133ENL995	3.3750 % FFCB 3 3/8 09/15/27	50	0	0	50 USD	96.31%	42'403.33	0.00	a)
US3133ENP954	4.2500 % FFCB 4 1/4 09/30/25	100	0	0	100 USD	99.08%	87'242.25	0.01	a)
US3133ENPG97	1.7500 % FFCB 1 3/4 02/14/25	100	0	0	100 USD	96.87%	85'297.12	0.01	a)
US3133ENWCO1	2.6250 % FFCB 2 5/8 05/03/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3133EPCF00	4.5000 % FFCB 4 1/2 03/02/26	0	100	0	100 USD	99.63%	87'732.72	0.01	a)
US3133EPNH47	3.8750 % FFCB 3 7/8 06/21/28	0	100	0	100 USD	97.93%	86'229.62	0.01	a)
US3133EPQC23	4.6250 % FFCB 4 5/8 07/17/26	0	100	0	100 USD	99.90%	87'967.83	0.01	a)
US3133EPWD32	4.8750 % FFCB 4 7/8 04/20/26	0	100	0	100 USD	100.40%	88'407.22	0.01	a)
US3133EPWK74	4.5000 % FFCB 4 1/2 09/22/28	0	150	0	150 USD	100.41%	132'628.00	0.01	a)
US3133XGAY07	5.5000 % FHLB 5 1/2 07/15/36	70	0	70	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3134A3U467	6.7500 % FHLMC 6 3/4 09/15/29 GDIF	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3134A4AA29	6.7500 % FHLMC 6 3/4 03/15/31	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3134A4KX12	6.2500 % FHLMC 6 1/4 07/15/32	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3134H1AA19	5.8500 % FHLMC 5.85 08/23/27	0	100	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31359MEU36	6.2500 % FNMA 6 1/4 05/15/29	0	100	0	100 USD	108.90%	95'894.54	0.01	a)
US31359MFJ71	7.1250 % FNMA 7 1/8 01/15/30	40	0	0	40 USD	114.29%	40'253.81	0.00	a)
US31359MFP32	7.2500 % FNMA 7 1/4 05/15/30	100	0	0	100 USD	115.69%	101'868.19	0.01	a)
US31359MGK36	6.6250 % FNMA 6 5/8 11/15/30	50	100	0	150 USD	112.88%	149'100.01	0.02	a)
US3135G03U56	0.6250 % FNMA 0 5/8 04/22/25	50	0	0	50 USD	95.24%	41'932.23	0.00	a)
US3135G04Z35	0.5000 % FNMA 0 1/2 06/17/25	50	0	0	50 USD	94.63%	41'662.34	0.00	a)
US3135G05Q27	0.8750 % FNMA 0 7/8 08/05/30	50	0	0	50 USD	80.61%	35'489.69	0.00	a)
US3135G05X77	0.3750 % FNMA 0 3/8 08/25/25	130	0	0	130 USD	93.69%	107'244.91	0.01	a)
US3135G05Y50	0.7500 % FNMA 0 3/4 10/08/27	100	0	0	100 USD	87.94%	77'433.81	0.01	a)
US3135G06G36	0.5000 % FNMA 0 1/2 11/07/25	60	0	0	60 USD	93.23%	49'254.62	0.01	a)
US3135G06H19	0.2500 % FNMA 0 1/4 11/27/23	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3135G0K368	2.1250 % FNMA 2 1/8 04/24/26	60	0	0	60 USD	95.09%	50'236.26	0.01	a)
US3135G0Q225	1.8750 % FNMA 1 7/8 09/24/26	100	0	0	100 USD	93.71%	82'518.98	0.01	a)
US3135G0X247	1.6250 % FNMA 1 5/8 01/07/25	100	0	0	100 USD	97.13%	85'527.82	0.01	a)
US3135G0ZR78	2.6250 % FNMA 2 5/8 09/06/24	60	0	0	60 USD	98.68%	52'135.08	0.01	a)
US3137EAEPO9	1.5000 % FHLMC 1 1/2 02/12/25	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3137EAEU93	0.3750 % FHLMC 0 3/8 07/21/25 USD	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3137EAEW59	0.2500 % FHLMC 0 1/4 09/08/23	120	0	120	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3137EAEX33	0.3750 % FHLMC 0 3/8 09/23/25	110	0	110	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3137EAEZ80	0.2500 % FHLMC 0 1/4 11/06/23	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US3137EAFZA1	0.2500 % FHLMC 0 1/4 12/04/23	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US31808LAF94	4.0000 % FINNVE 4 06/15/28 144A	0	200	0	200 USD	97.88%	172'367.66	0.02	a)
US38376HAH12	2.0000 % BOEN 2 03/21/25 144A	200	0	0	200 USD	96.82%	170'513.22	0.02	a)
US38611TDL89	3.2360 % 38611TDL8	0	100	0	100 USD	72.47%	63'812.49	0.01	a)
US427028AB18	0.7500 % CANADA 0 3/4 05/19/26	60	0	0	60 USD	91.93%	48'567.79	0.00	a)
US445545AF36	7.6250 % REPHUN 7 5/8 03/29/41	30	80	0	110 USD	114.56%	110'962.42	0.01	a)
US445545AL04	5.3750 % REPHUN 5 3/8 03/25/24	10	0	0	10 USD	99.91%	8'797.13	0.00	a)
US452151LF83	5.1000 % 452151LF8	150	0	0	150 USD	98.51%	130'111.30	0.01	a)
US455780CV60	1.8500 % INDON 1.85 03/12/31	200	0	0	200 USD	81.01%	142'661.43	0.01	a)
US455780CW44	3.0500 % INDON 3.05 03/12/51	200	0	0	200 USD	69.72%	122'780.37	0.01	a)
US4581X0CY26	2.3750 % IADB 2 3/8 07/07/27	0	250	0	250 USD	93.50%	205'832.97	0.02	a)
US4581X0DC96	3.1250 % IADB 3 1/8 09/18/28	70	0	0	70 USD	94.77%	58'411.72	0.01	a)
US4581X0DF28	2.6250 % IADB 2 5/8 01/16/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DL95	0.8750 % IADB 0 7/8 04/03/25	50	0	0	50 USD	95.59%	42'083.69	0.00	a)
US4581X0DN51	0.6250 % IADB 0 5/8 07/15/25	50	0	0	50 USD	94.33%	41'531.14	0.00	a)
US4581X0DP00	0.2500 % IADB 0 1/4 11/15/23	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US4581X0DS49	1.1250 % IADB 1 1/8 01/13/31 GMTN	70	0	0	70 USD	80.80%	49'803.91	0.01	a)
US4581X0DV77	0.8750 % IADB 0 7/8 04/20/26 GMTN	100	0	0	100 USD	92.40%	81'361.06	0.01	a)
US4581X0DX34	1.1250 % IADB 1 1/8 07/20/28	80	0	0	80 USD	87.06%	61'330.66	0.01	a)
US4581X0DZ81	0.5000 % IADB 0 1/2 09/23/24	100	0	0	100 USD	97.38%	85'745.32	0.01	a)
US4581X0EB05	1.5000 % IADB 1 1/2 01/13/27	70	60	0	130 USD	91.98%	105'287.45	0.01	a)
US4581X0EF19	3.5000 % IADB 3 1/2 09/14/29	50	70	0	120 USD	95.60%	101'014.58	0.01	a)
US4581X0EH74	4.0000 % IADB 4 01/12/28	0	40	0	40 USD	98.37%	34'646.47	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US4581X0EJ31	3.5000 % IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN	0	50	0	50 USD	93.06%	40'973.31	0.00	a)
US459056HV23	1.5000 % IBRD 1 1/2 08/28/24 GDIF	60	0	0	60 USD	98.17%	51'866.68	0.01	a)
US459058EP48	2.5000 % IBRD 2 1/2 07/29/25 GDIF	100	0	0	100 USD	96.75%	85'188.81	0.01	a)
US459058FT50	1.8750 % IBRD 1 7/8 10/27/26 GDIF	0	30	0	30 USD	93.38%	24'668.52	0.00	a)
US459058GE72	2.5000 % IBRD 2 1/2 11/22/27 GDIF	0	60	0	60 USD	93.37%	49'331.76	0.01	a)
US459058GL16	3.0000 % IBRD 3 09/27/23	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058GQ03	2.5000 % IBRD 2 1/2 03/19/24	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459058HT33	1.6250 % IBRD 1 5/8 01/15/25	60	0	0	60 USD	97.03%	51'262.80	0.01	a)
US459058JA24	0.7500 % IBRD 0 3/4 03/11/25	50	0	0	50 USD	95.72%	42'143.12	0.00	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	130	0	0	130 USD	95.19%	108'960.84	0.01	a)
US459058JC89	0.8750 % IBRD 0 7/8 05/14/30	110	0	0	110 USD	80.88%	78'342.71	0.01	a)
US459058JE46	0.3750 % IBRD 0 3/8 07/28/25	50	0	0	50 USD	93.90%	41'342.26	0.00	a)
US459058JG93	0.7500 % IBRD 0 3/4 08/26/30	0	60	0	60 USD	79.50%	42'003.82	0.00	a)
US459058JL88	0.5000 % IBRD 0 1/2 10/28/25	60	40	0	100 USD	93.20%	82'065.50	0.01	a)
US459058JN45	0.7500 % IBRD 0 3/4 11/24/27	90	0	0	90 USD	87.40%	69'264.86	0.01	a)
US459058JR58	1.2500 % IBRD 1 1/4 02/10/31	80	0	0	80 USD	81.31%	57'276.61	0.01	a)
US459058JW44	1.3750 % IBRD 1 3/8 04/20/28 GDIF	70	0	0	70 USD	88.54%	54'572.88	0.01	a)
US459058JX27	0.8750 % IBRD 0 7/8 07/15/26	50	0	0	50 USD	91.74%	40'390.83	0.00	a)
US459058JZ74	1.1250 % IBRD 1 1/8 09/13/28	70	60	0	130 USD	86.70%	99'244.50	0.01	a)
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	70	0	0	70 USD	82.22%	50'677.94	0.01	a)
US459058KJ14	3.1250 % IBRD 3 1/8 06/15/27	60	0	0	60 USD	95.94%	50'687.45	0.01	a)
US459058KL69	3.6250 % IBRD 3 5/8 09/21/29	80	0	0	80 USD	96.30%	67'839.69	0.01	a)
US459058KQ56	3.8750 % IBRD 3 7/8 02/14/30	0	80	0	80 USD	97.28%	68'524.40	0.01	a)
US459058KT95	3.5000 % IBRD 3 1/2 07/12/28	0	80	0	80 USD	96.46%	67'950.28	0.01	a)
US459058KU68	4.0000 % IBRD 4 07/25/30	0	80	0	80 USD	97.76%	68'863.24	0.01	a)
US459058KW25	4.6250 % IBRD 4 5/8 08/01/28	0	60	0	60 USD	100.95%	53'336.50	0.01	a)
US459058KY80	4.7500 % IBRD 4 3/4 11/14/33	0	60	0	60 USD	102.72%	54'270.06	0.01	a)
US45906M3D11	2.5000 % IBRD 2 1/2 03/29/32	50	0	0	50 USD	87.33%	38'447.89	0.00	a)
US45939E2A70	4.8750 % IDAWBG 4 7/8 11/01/28 144A	0	60	0	60 USD	101.87%	53'820.98	0.01	a)
US45939EAB65	0.3750 % IDAWBG 0 3/8 09/23/25 144A	50	0	0	50 USD	93.31%	41'082.50	0.00	a)
US45939EAC49	1.0000 % IDAWBG 1 12/03/30 144A	0	50	0	50 USD	79.99%	35'217.16	0.00	a)
US45950KCR95	1.3750 % IFC 1 3/8 10/16/24 GMTN	50	0	0	50 USD	97.62%	42'980.09	0.00	a)
US45950KCX63	0.7500 % IFC 0 3/4 10/08/26 GMTN	50	0	0	50 USD	90.80%	39'977.41	0.00	a)
US45950KDA51	3.6250 % IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN	70	0	0	70 USD	98.15%	60'496.34	0.01	a)
US45950KDD90	4.5000 % IFC 4 1/2 07/13/28 GMTN	0	70	0	70 USD	100.44%	61'907.86	0.01	a)
US45950KDF49	4.3750 % IFC 4 3/8 01/15/27 GMTN	0	50	0	50 USD	99.68%	43'886.17	0.00	a)
US4651387N91	4.5000 % ISRAEL 4 1/2 01/30/43	0	200	0	200 USD	86.16%	151'734.61	0.02	a)
US46513EJX13	5.5000 % AID 5 1/2 04/26/24	50	0	0	50 USD	99.96%	44'008.57	0.00	a)
US46514BRA79	4.5000 % ISRAEL 4 1/2 01/17/33	0	200	0	200 USD	92.97%	163'729.47	0.02	a)
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	200	0	0	200 USD	92.41%	162'745.01	0.02	a)
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51	200	0	0	200 USD	69.21%	121'882.21	0.01	a)
US471048BY30	2.5000 % JBIC 2 1/2 05/23/24 DTC	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US471048CQ96	2.1250 % JBIC 2 1/8 02/16/29	200	0	0	200 USD	88.72%	156'237.75	0.02	a)
US471048CV81	4.2500 % JBIC 4 1/4 01/26/26	200	0	0	200 USD	98.69%	173'797.68	0.02	a)
US471048CX48	4.6250 % JBIC 4 5/8 07/19/28	0	200	0	200 USD	99.78%	175'717.27	0.02	a)
US47109LAF13	3.2500 % JICA 3 1/4 05/25/27	0	200	0	200 USD	95.19%	167'632.06	0.02	a)
US50046PBW41	1.3750 % KOMINS 1 3/8 05/08/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US50046PC77	4.2500 % KOMINS 4 1/4 12/10/25 144A	0	200	0	200 USD	98.89%	174'148.13	0.02	a)
US50048MCU27	0.8750 % KBN 0 7/8 03/12/25 144A	0	200	0	200 USD	95.69%	168'517.90	0.02	a)
US50048MCZ14	0.5000 % KBN 0 1/2 01/13/26 144A	200	0	0	200 USD	92.34%	162'623.50	0.02	a)
US500630DQ87	2.0000 % KDB 2 02/24/25	200	0	0	200 USD	96.98%	170'795.00	0.02	a)
US500630DW55	4.3750 % KDB 4 3/8 02/15/28	0	200	0	200 USD	98.59%	173'628.61	0.02	a)
US50064FAQ72	2.5000 % KOREA 2 1/2 06/19/29	200	0	0	200 USD	90.61%	159'567.99	0.02	a)
US50066CAR07	2.0000 % KORGAS 2 07/13/31 REGS	200	0	0	200 USD	81.26%	143'112.27	0.01	a)
US50066RAR75	1.7500 % KOROIL 1 3/4 04/18/25 REGS	200	0	0	200 USD	96.04%	169'139.57	0.02	a)
US500769CH58	0.0000 % KFW 0 06/29/37	0	80	0	80 USD	54.72%	38'544.84	0.00	a)
US500769GQ12	2.0000 % KFW 2 05/02/25	60	0	0	60 USD	96.60%	51'034.04	0.01	a)
US500769HS68	2.8750 % KFW 2 7/8 04/03/28	0	70	0	70 USD	94.20%	58'061.62	0.01	a)
US500769HX53	2.6250 % KFW 2 5/8 02/28/24	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JC98	1.3750 % KFW 1 3/8 08/05/24	60	0	0	60 USD	98.34%	51'954.92	0.01	a)
US500769JF20	0.3750 % KFW 0 3/8 07/18/25	60	0	0	60 USD	94.00%	49'660.91	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US500769JG03	0.7500 % KFW 0 3/4 09/30/30	50	50	0	100 USD	79.64%	70'129.64	0.01	a)
US500769JH85	0.2500 % KFW 0 1/4 10/19/23	60	0	60	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JU42	0.6250 % KFW 0 5/8 01/22/26	50	0	0	50 USD	92.69%	40'808.21	0.00	a)
US500769JM70	0.2500 % KFW 0 1/4 03/08/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JP02	0.5000 % KFW 0 1/2 09/20/24	60	0	0	60 USD	97.39%	51'455.12	0.01	a)
US500769JQ84	1.0000 % KFW 1 10/01/26	60	0	0	60 USD	91.50%	48'343.25	0.00	a)
US500769JR67	1.2500 % KFW 1 1/4 01/31/25	50	0	0	50 USD	96.55%	42'508.55	0.00	a)
US500769JT24	3.0000 % KFW 3 05/20/27	80	0	0	80 USD	95.54%	67'300.08	0.01	a)
US500769JU96	3.1250 % KFW 3 1/8 06/10/25	50	0	0	50 USD	97.74%	43'031.16	0.00	a)
US500769JV79	3.3750 % KFW 3 3/8 08/23/24	50	0	0	50 USD	99.07%	43'616.72	0.00	a)
US500769JW52	3.7500 % KFW 3 3/4 02/15/28	70	0	0	70 USD	97.49%	60'089.52	0.01	a)
US500769JX36	3.6250 % KFW 3 5/8 04/01/26	0	100	0	100 USD	97.94%	86'241.95	0.01	a)
US500769JY19	4.1250 % KFW 4 1/8 07/15/33	0	80	0	80 USD	97.75%	68'856.19	0.01	a)
US500769JZ83	4.6250 % KFW 4 5/8 08/07/26	0	80	0	80 USD	100.05%	70'481.34	0.01	a)
US500769KA14	5.1250 % KFW 5 1/8 09/29/25	0	70	0	70 USD	100.39%	61'878.27	0.01	a)
US515110BN30	2.0000 % RENTEN 2 01/13/25	70	0	0	70 USD	97.31%	59'981.66	0.01	a)
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	0	60	0	60 USD	93.53%	49'412.06	0.01	a)
US515110BV55	3.1250 % RENTEN 3 1/8 11/14/23	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US515110BY94	0.8750 % RENTEN 0 7/8 09/03/30	50	0	0	50 USD	80.05%	35'241.81	0.00	a)
US515110CC65	3.8750 % RENTEN 3 7/8 09/28/27	0	50	0	50 USD	97.99%	43'141.23	0.00	a)
US515110CD49	3.8750 % RENTEN 3 7/8 06/14/28 44	0	70	0	70 USD	97.85%	60'312.04	0.01	a)
US563469UU76	2.6000 % MP 2.6 04/16/24 GX	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US563469VC69	4.3000 % MP 4.3 07/27/33	0	70	0	70 USD	96.94%	59'752.98	0.01	a)
US576004HG34	4.1100 % 576004HG3	0	100	0	100 USD	96.36%	55'951.53	0.01	a)
US576004HG34XX	4.1100 % 576004HG3	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59259NZH96	7.3360 % 59259NZH9	0	150	0	150 USD	120.47%	159'121.90	0.02	a)
US59259NZH96XXX	7.3360 % *RETIRED*	0	150	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US59335KFS15	6.2240 % 59335KFS1	0	100	0	100 USD	106.27%	93'574.29	0.01	a)
US62630CEE75	0.6250 % KUNTA 0 5/8 03/20/26 144A	200	0	0	200 USD	91.99%	161'996.54	0.02	a)
US62878U2B73	2.6250 % NBNAUS 2 5/8 05/05/31 144A	0	200	0	200 USD	84.79%	149'316.62	0.02	a)
US638602BS06	5.2640 % NWDIE 5.264 11/10/26 144A	0	200	0	200 USD	100.79%	177'501.27	0.02	a)
US63983TED37	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US646139X831	7.1020 % 646139X83	100	0	0	100 USD	116.89%	102'923.70	0.01	a)
US64966QL651	5.2630 % 64966QL65	0	150	0	150 USD	101.88%	134'561.82	0.01	a)
US65562QBS30	0.3750 % NIB 0 3/8 09/20/24	200	0	0	200 USD	97.35%	171'439.56	0.02	a)
US676167BX63	3.1250 % OKB 3 1/8 11/07/23	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US676167CB35	0.3750 % OKB 0 3/8 09/17/25	60	0	0	60 USD	93.34%	49'316.44	0.01	a)
US676167CF49	3.6250 % OKB 3 5/8 09/09/27	80	0	0	80 USD	97.13%	68'425.07	0.01	a)
US676167CH05	4.1250 % OKB 4 1/8 01/20/26	0	80	0	80 USD	98.81%	69'607.13	0.01	a)
US682142AG97	3.5000 % OMERFT 3 1/2 04/19/32 144A	250	0	0	250 USD	90.32%	198'837.00	0.02	a)
US683234AR91	1.1250 % ONT 1 1/8 10/07/30	0	70	0	70 USD	80.63%	49'696.04	0.01	a)
US683234AS74	0.6250 % ONT 0 5/8 01/21/26	100	0	0	100 USD	92.49%	81'444.71	0.01	a)
US683234AU21	2.1250 % ONT 2 1/8 01/21/32 MTN	50	0	0	50 USD	84.02%	36'991.91	0.00	a)
US683234FF66	2.3000 % ONT 2.3 06/15/26	100	0	0	100 USD	94.74%	83'419.78	0.01	a)
US68329AAK43	0.8750 % ONTFT 0 7/8 09/21/26 144A	250	0	0	250 USD	90.81%	199'909.07	0.02	a)
US69370RAC16	6.5000 % PERTU 6 1/2 11/07/48 REGS	200	0	0	200 USD	106.04%	186'752.33	0.02	a)
US69376P2D61	3.5000 % PSPCAP 3 1/2 06/29/27 144A	0	250	0	250 USD	96.54%	212'525.15	0.02	a)
US698299BH68	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/16/50	0	200	0	200 USD	65.09%	114'622.95	0.01	a)
US698299BM53	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/01/56	200	0	0	200 USD	63.05%	111'030.31	0.01	a)
US698299BR41	3.2980 % PANAMA 3.298 01/19/33	200	0	0	200 USD	75.48%	132'926.07	0.01	a)
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	40	0	0	40 USD	122.76%	43'237.47	0.00	a)
US715638BM30	5.6250 % PERU 5 5/8 11/18/50	40	0	0	40 USD	98.97%	34'859.21	0.00	a)
US715638DA73	2.8440 % PERU 2.844 06/20/30	60	60	60	60 USD	87.15%	46'042.90	0.00	a)
US715638DE95	2.3920 % PERU 2.392 01/23/26	50	0	0	50 USD	94.66%	41'675.55	0.00	a)
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	50	0	0	50 USD	85.06%	37'451.11	0.00	a)
US715638DQ26	2.7800 % PERU 2.78 12/01/60	50	0	0	50 USD	57.34%	25'247.13	0.00	a)
US715638DS81	3.3000 % PERU 3.3 03/11/41	40	0	0	40 USD	74.19%	26'131.20	0.00	a)
US715638DT64	3.5500 % PERU 3.55 03/10/51	0	50	0	50 USD	71.76%	31'595.90	0.00	a)
US715638DU38	3.0000 % PERU 3 01/15/34	40	0	0	40 USD	81.30%	28'635.13	0.00	a)
US715638DW93	3.6000 % PERU 3.6 01/15/2072	40	0	0	40 USD	65.67%	23'128.88	0.00	a)
US71567RAF38	4.5500 % INDOIS 4.55 03/29/26 REGS	200	0	0	200 USD	99.05%	174'435.19	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US71567RAV87	4.7000 % INDOIS 4.7 06/06/32 REGS	0	200	0	200 USD	97.89%	172'387.03	0.02	a)
US71568QAF46	6.1500 % PLNIJ 6.15 05/21/48 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718286BG11	6.3750 % PHILIP 6 3/8 10/23/34	200	200	0	200 USD	109.80%	193'367.02	0.02	a)
US718286CC97	3.0000 % PHILIP 3 02/01/28	200	0	0	200 USD	92.87%	163'549.83	0.02	a)
US718286CN52	1.9500 % PHILIP 1.95 01/06/32	200	0	0	200 USD	79.82%	140'572.76	0.01	a)
US718286CP01	3.2000 % PHILIP 3.2 07/06/46	200	0	0	200 USD	71.20%	125'381.51	0.01	a)
US731011AU68	3.2500 % POLAND 3 1/4 04/06/26	50	0	0	50 USD	97.27%	42'824.23	0.00	a)
US731011AV42	4.8750 % POLAND 4 7/8 10/04/33	0	80	0	80 USD	97.91%	68'971.02	0.01	a)
US731011AW25	5.5000 % POLAND 5 1/2 04/04/53	0	40	0	40 USD	99.88%	35'179.03	0.00	a)
US73358WRP13	4.9600 % 73358WRP1	100	0	0	100 USD	95.63%	84'203.91	0.01	a)
US748148QR73	7.5000 % Q 7 1/2 09/15/29 PD	50	0	0	50 USD	114.14%	50'252.55	0.01	a)
US748148RZ80	1.5000 % Q 1 1/2 02/11/25 QX	60	0	0	60 USD	96.59%	51'032.98	0.01	a)
US748148SD69	3.6250 % Q 3 5/8 04/13/28	0	60	0	60 USD	96.45%	50'959.01	0.01	a)
US748149AH49	2.8750 % Q 2 7/8 10/16/24 QO	50	0	0	50 USD	98.47%	43'352.56	0.00	a)
US748149AJ05	2.5000 % Q 2 1/2 04/20/26	60	0	0	60 USD	95.46%	50'436.50	0.01	a)
US748149AR21	1.9000 % Q 1.9 04/21/31	50	0	0	50 USD	83.82%	36'903.41	0.00	a)
US760942AY83	4.1250 % URUGUA 4 1/8 11/20/45	0	40	0	40 USD	87.09%	30'673.08	0.00	a)
US760942BA98	5.1000 % URUGUA 5.1 06/18/50	60	0	0	60 USD	96.02%	50'730.25	0.01	a)
US760942BB71	4.3750 % URUGUA 4 3/8 10/27/27	50	0	0	50 USD	98.85%	43'519.42	0.00	a)
US760942BD38	4.9750 % URUGUA 4.975 04/20/55	60	0	0	60 USD	93.12%	49'196.50	0.01	a)
US760942BE11	5.7500 % URUGUA 5 3/4 10/28/34	40	0	0	40 USD	105.14%	37'031.71	0.00	a)
US780082AH66	1.0500 % RY 1.05 09/14/26 144A	200	0	0	200 USD	90.82%	159'934.30	0.02	a)
US780082AK95	3.4000 % RY 3.4 06/09/25 144A	200	0	0	200 USD	97.72%	172'101.74	0.02	a)
US803854KQ02	3.2500 % SCDA 3 1/4 06/08/27	0	40	0	40 USD	95.75%	33'724.01	0.00	a)
US857524AD47	5.5000 % POLAND 5 1/2 11/16/27	0	50	0	50 USD	102.37%	45'069.19	0.00	a)
US857524AE20	5.7500 % POLAND 5 3/4 11/16/32	50	0	0	50 USD	104.26%	45'903.95	0.00	a)
US85771PAN24	3.7000 % EQNR 3.7 03/01/24	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87020D2C78	4.3750 % SWED 4 3/8 01/30/26 144A	0	100	0	100 USD	99.36%	87'487.93	0.01	a)
US87031CAC73	0.6250 % SEK 0 5/8 10/07/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87031CAM55	4.8750 % SEK 4 7/8 09/14/26 GMTN	0	200	0	200 USD	100.39%	176'800.35	0.02	a)
US87973PBB94	2.3750 % TEMASE 2 3/8 08/02/41 144A	0	250	0	250 USD	73.45%	161'679.99	0.02	a)
US880591CS97	5.8800 % TVA 5.88 04/01/36	50	0	0	50 USD	111.30%	49'000.85	0.01	a)
US880591EH15	5.2500 % TVA 5 1/4 09/15/39	50	0	0	50 USD	103.59%	45'606.33	0.00	a)
US880591EP31	3.5000 % TVA 3 1/2 12/15/42	50	0	0	50 USD	81.26%	35'774.99	0.00	a)
US880591ES79	4.2500 % TVA 4 1/4 09/15/65	80	0	0	80 USD	86.86%	61'184.84	0.01	a)
US880591EU26	2.8750 % TVA 2 7/8 02/01/27 A	100	0	0	100 USD	95.50%	84'094.29	0.01	a)
US882722KF74	5.5170 % 882722KF7	0	150	0	150 USD	104.58%	138'128.84	0.01	a)
US891160TB95	3.3010 % TD 3.301 04/20/27 144A	200	0	0	200 USD	95.39%	167'984.28	0.02	a)
US91086QBF46	4.6000 % MEX 4.6 01/23/46	200	0	0	200 USD	79.78%	140'505.84	0.01	a)
US91087BAE02	3.7500 % MEX 3 3/4 01/11/28	200	0	0	200 USD	94.63%	166'656.42	0.02	a)
US91087BAK61	4.7500 % MEX 4 3/4 04/27/32	200	0	0	200 USD	94.13%	165'765.30	0.02	a)
US91087BAL45	5.0000 % MEX 5 04/27/51	200	0	0	200 USD	83.22%	146'564.03	0.01	a)
US91087BAQ32	4.2800 % MEX 4.28 08/14/41	200	0	0	200 USD	79.43%	139'887.70	0.01	a)
US91087BAR15	3.5000 % MEX 3 1/2 02/12/34	0	200	0	200 USD	82.65%	145'554.92	0.01	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	60	100	0	160 USD	103.44%	145'731.03	0.01	a)
US912810PT97	4.7500 % T 4 3/4 02/15/37	69	0	0	69 USD	105.55%	64'128.11	0.01	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	150	0	0	150 USD	107.88%	142'484.00	0.01	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	150	0	0	150 USD	101.13%	133'568.43	0.01	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	75	100	0	175 USD	102.22%	157'515.26	0.02	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	100	0	0	100 USD	90.92%	80'061.26	0.01	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	239	0	0	239 USD	98.89%	208'116.75	0.02	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	130	130	0	260 USD	101.56%	232'520.23	0.02	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	200	0	0	200 USD	99.95%	176'027.45	0.02	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	160	150	0	310 USD	102.69%	280'306.58	0.03	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	100	100	0	200 USD	99.59%	175'394.55	0.02	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	150	100	0	250 USD	93.48%	205'794.17	0.02	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	100	200	0	300 USD	97.72%	258'138.74	0.03	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	325	0	0	325 USD	103.69%	296'731.60	0.03	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	200	0	0	200 USD	98.89%	174'156.28	0.02	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	160	120	0	280 USD	91.20%	224'864.95	0.02	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	443	0	150	293 USD	83.23%	214'745.65	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	140	100	0	240 USD	82.92%	175'240.46	0.02	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	100	150	0	250 USD	81.03%	178'380.17	0.02	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	200	100	0	300 USD	77.78%	205'470.84	0.02	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	204	260	0	464 USD	77.50%	316'645.78	0.03	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	200	220	140	280 USD	82.08%	202'366.90	0.02	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	508	120	0	628 USD	78.70%	435'216.79	0.04	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	220	150	0	370 USD	88.16%	287'216.15	0.03	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	200	270	0	470 USD	89.67%	371'114.67	0.04	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	408	0	0	408 USD	87.91%	315'815.86	0.03	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	256	300	120	436 USD	84.55%	324'592.20	0.03	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	476	0	0	476 USD	81.14%	340'094.28	0.03	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	250	200	0	450 USD	79.33%	314'335.71	0.03	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	400	150	0	550 USD	72.48%	351'043.64	0.04	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	352	0	0	352 USD	79.09%	245'153.93	0.03	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	200	130	0	330 USD	77.22%	224'383.41	0.02	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	204	0	0	204 USD	78.80%	141'544.56	0.01	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	428	0	0	428 USD	71.77%	270'466.99	0.03	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	370	200	0	570 USD	71.58%	359'260.27	0.04	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	479	150	0	629 USD	67.92%	376'196.13	0.04	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	230	0	0	230 USD	76.52%	154'964.42	0.02	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	426	100	0	526 USD	78.14%	361'923.39	0.04	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	291	100	0	391 USD	78.03%	268'657.73	0.03	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	280	280	0	560 USD	74.34%	366'594.98	0.04	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	617	0	0	617 USD	74.20%	403'145.09	0.04	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	387	350	120	617 USD	77.72%	422'245.47	0.04	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	400	330	0	730 USD	79.47%	510'826.32	0.05	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	759	0	0	759 USD	77.59%	518'588.09	0.05	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	457	340	0	797 USD	83.06%	582'931.26	0.06	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	769	100	0	869 USD	77.50%	593'028.41	0.06	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	721	120	0	841 USD	75.61%	559'919.59	0.06	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	486	250	0	736 USD	66.25%	429'356.18	0.04	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	702	0	0	702 USD	68.03%	420'532.52	0.04	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	725	620	490	855 USD	62.28%	468'897.00	0.05	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	670	460	0	1'130 USD	50.80%	505'439.83	0.05	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	1'048	150	0	1'198 USD	52.50%	553'821.92	0.06	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	793	0	0	793 USD	61.09%	426'603.09	0.04	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	720	0	0	720 USD	61.70%	391'195.34	0.04	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	720	350	0	1'070 USD	56.17%	529'244.94	0.05	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	480	440	0	920 USD	63.48%	514'290.73	0.05	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	1'122	170	0	1'292 USD	59.89%	681'358.04	0.07	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	880	160	0	1'040 USD	68.91%	631'024.14	0.06	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	1'032	310	0	1'342 USD	67.52%	797'830.86	0.08	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	758	250	0	1'008 USD	73.02%	648'082.60	0.07	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	1'070	320	0	1'390 USD	61.63%	754'268.12	0.08	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	993	160	0	1'153 USD	66.61%	676'267.76	0.07	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	770	480	0	1'250 USD	59.63%	656'284.92	0.07	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	530	620	0	1'150 USD	69.22%	700'931.56	0.07	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	1'086	120	0	1'206 USD	65.45%	695'075.08	0.07	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	752	220	140	832 USD	73.52%	538'588.41	0.06	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	670	470	160	980 USD	75.34%	650'170.60	0.07	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	662	250	120	792 USD	84.13%	586'684.05	0.06	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	861	220	0	1'081 USD	77.36%	736'364.20	0.08	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	615	0	0	615 USD	85.52%	463'099.82	0.05	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	813	220	0	1'033 USD	93.67%	852'047.01	0.09	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	635	0	0	635 USD	93.38%	522'105.61	0.05	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	341	880	150	1'071 USD	87.47%	824'890.71	0.08	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	290	410	0	700 USD	91.59%	564'570.14	0.06	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	1'110	0	1'110 USD	87.55%	855'692.35	0.09	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	0	690	0	690 USD	91.45%	555'650.44	0.06	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	1'200	0	1'200 USD	95.81%	1'012'412.36	0.10	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	0	700	0	700 USD	97.94%	603'672.06	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	0	1'150	0	1'150 USD	106.47%	1'078'137.17	0.11	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	0	550	0	550 USD	102.94%	498'528.89	0.05	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	788	240	0	1'028 USD	93.04%	842'194.62	0.09	a)
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	370	0	0	370 USD	98.70%	321'552.79	0.03	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	737	0	0	737 USD	93.23%	605'008.09	0.06	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	150	250	0	400 USD	98.32%	346'317.57	0.04	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	150	0	0	150 USD	98.21%	129'724.62	0.01	a)
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	200	0	0	200 USD	98.07%	172'704.75	0.02	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	658	240	0	898 USD	92.85%	734'208.79	0.08	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	380	0	0	380 USD	97.76%	327'119.51	0.03	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	380	0	0	380 USD	97.66%	326'792.75	0.03	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	366	0	0	366 USD	97.69%	314'828.54	0.03	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	630	480	0	1'110 USD	94.27%	921'438.48	0.09	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	329	0	0	329 USD	97.78%	283'273.21	0.03	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	160	0	0	160 USD	97.51%	137'376.81	0.01	a)
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	280	0	0	280 USD	97.64%	240'746.50	0.02	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	1'037	100	0	1'137 USD	94.49%	946'041.95	0.10	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	385	0	0	385 USD	97.54%	330'682.13	0.03	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	1'015	350	200	1'165 USD	94.25%	966'854.91	0.10	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	200	130	0	330 USD	97.02%	281'909.46	0.03	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	250	100	0	350 USD	97.30%	299'861.67	0.03	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	316	0	0	316 USD	97.20%	270'471.39	0.03	a)
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	945	100	0	1'045 USD	95.08%	874'884.90	0.09	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	450	0	0	450 USD	96.93%	384'081.47	0.04	a)
US9128285P13	2.8750 % T 2 7/8 11/30/23	362	0	362	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	300	0	0	300 USD	96.42%	254'702.53	0.03	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	250	150	0	400 USD	96.31%	339'231.89	0.03	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	955	350	250	1'055 USD	92.66%	860'758.27	0.09	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	220	370	0	590 USD	95.98%	498'642.05	0.05	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	240	120	0	360 USD	95.38%	302'336.84	0.03	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	345	0	345	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	436	0	0	436 USD	95.48%	366'583.43	0.04	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	716	150	100	766 USD	91.23%	615'377.04	0.06	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	455	0	0	455 USD	94.84%	379'991.72	0.04	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	200	250	0	450 USD	94.22%	373'339.45	0.04	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	470	0	0	470 USD	98.69%	408'426.61	0.04	a)
US9128288G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	846	0	0	846 USD	97.97%	729'842.70	0.07	a)
US9128288J272	2.0000 % T 2 02/15/25	768	0	0	768 USD	97.11%	656'687.77	0.07	a)
US9128288K742	2.0000 % T 2 08/15/25	888	0	0	888 USD	96.05%	751'048.34	0.08	a)
US9128288M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	773	150	0	923 USD	95.95%	779'856.77	0.08	a)
US9128288P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	814	120	0	934 USD	94.41%	776'428.82	0.08	a)
US9128288R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	768	150	0	918 USD	93.86%	758'707.47	0.08	a)
US9128288T263	1.3750 % T 1 3/8 09/30/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288T917	1.6250 % T 1 5/8 10/31/23	100	0	100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288U246	2.0000 % T 2 11/15/26	743	120	0	863 USD	93.76%	712'479.36	0.07	a)
US9128288U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	321	0	321	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	735	100	0	835 USD	94.02%	691'316.03	0.07	a)
US9128288W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	357	0	357	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	390	0	390	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	436	0	436	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288X703	2.0000 % T 2 04/30/24	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	764	220	0	984 USD	94.01%	814'541.22	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	827	0	0	827 USD	96.73%	704'434.08	0.07	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	350	0	0	350 USD	99.18%	305'652.32	0.03	a)
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	300	0	0	300 USD	98.89%	261'234.42	0.03	a)
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	320	0	0	320 USD	97.31%	274'192.26	0.03	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	200	120	0	320 USD	97.32%	274'214.28	0.03	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	250	0	0	250 USD	98.54%	216'930.03	0.02	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	250	100	0	350 USD	94.00%	289'700.95	0.03	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	739	100	0	839 USD	87.49%	646'376.06	0.07	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	351	100	0	451 USD	92.66%	367'994.98	0.04	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	250	0	0	250 USD	98.02%	215'786.35	0.02	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	190	100	0	290 USD	93.13%	237'823.49	0.02	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	250	0	0	250 USD	97.87%	215'442.38	0.02	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	250	0	0	250 USD	97.59%	214'831.84	0.02	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	500	0	0	500 USD	92.89%	408'974.20	0.04	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	300	290	0	590 USD	87.70%	455'598.64	0.05	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	220	150	0	370 USD	92.76%	302'208.20	0.03	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	453	0	0	453 USD	97.30%	388'106.67	0.04	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	478	0	0	478 USD	92.92%	391'110.86	0.04	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	570	0	0	570 USD	97.27%	488'189.30	0.05	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	385	200	0	585 USD	96.69%	498'078.47	0.05	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	1'143	250	0	1'393 USD	92.06%	1'129'244.29	0.12	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	590	550	0	1'140 USD	85.56%	858'899.48	0.09	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	100	120	0	220 USD	90.85%	175'998.56	0.02	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	330	0	0	330 USD	96.21%	279'571.19	0.03	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	250	200	0	450 USD	89.23%	353'588.98	0.04	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	621	0	0	621 USD	95.30%	521'103.85	0.05	a)
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	391	0	0	391 USD	94.86%	326'609.58	0.03	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	300	270	0	570 USD	88.59%	444'624.78	0.05	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	1'207	220	0	1'427 USD	80.29%	1'008'868.09	0.10	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	280	250	0	530 USD	88.32%	412'183.39	0.04	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	480	0	0	480 USD	94.38%	398'922.17	0.04	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	350	270	0	620 USD	88.07%	480'811.95	0.05	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	673	0	0	673 USD	94.10%	557'655.41	0.06	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	732	0	0	732 USD	93.77%	604'403.33	0.06	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	500	250	0	750 USD	87.41%	577'241.81	0.06	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'425	350	0	1'775 USD	79.62%	1'244'397.74	0.13	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	415	250	0	665 USD	87.56%	512'736.01	0.05	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	767	0	0	767 USD	93.46%	631'244.59	0.06	a)
US91282CAK71	0.1250 % T 0 1/8 09/15/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	520	270	0	790 USD	86.91%	604'549.86	0.06	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	550	240	0	790 USD	93.16%	648'054.18	0.07	a)
US91282CAP68	0.1250 % T 0 1/8 10/15/23	340	0	340	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	710	120	0	830 USD	92.86%	678'668.78	0.07	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	480	400	0	880 USD	87.05%	674'572.84	0.07	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'551	420	140	1'831 USD	80.50%	1'297'891.08	0.13	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	570	280	0	850 USD	87.24%	652'979.43	0.07	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	350	400	0	750 USD	92.77%	612'687.39	0.06	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	773	270	0	1'043 USD	86.98%	798'876.37	0.08	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	761	250	0	1'011 USD	92.51%	823'572.67	0.08	a)
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	448	0	448	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	922	150	0	1'072 USD	92.21%	870'387.90	0.09	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	1'021	0	0	1'021 USD	87.20%	783'992.33	0.08	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'466	400	0	1'866 USD	81.55%	1'339'901.84	0.14	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	648	400	0	1'048 USD	88.34%	815'250.61	0.08	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	964	0	0	964 USD	92.19%	782'533.78	0.08	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	544	0	544	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	580	400	0	980 USD	88.61%	764'644.86	0.08	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	841	250	0	1'091 USD	92.46%	888'253.78	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	430	550	0	980 USD	92.17%	795'387.06	0.08	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	1'024	0	0	1'024 USD	88.41%	797'144.30	0.08	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'416	600	310	1'706 USD	83.83%	1'259'281.43	0.13	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	540	0	540	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	640	460	0	1'100 USD	88.21%	854'415.56	0.09	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	713	370	0	1'083 USD	91.93%	876'674.28	0.09	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	440	0	0	440 USD	98.54%	381'796.85	0.04	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	620	470	150	940 USD	88.02%	728'584.96	0.07	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	752	100	0	852 USD	92.02%	690'327.54	0.07	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	250	0	0	250 USD	98.18%	216'130.31	0.02	a)
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	837	250	0	1'087 USD	91.17%	872'658.76	0.09	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	981	150	0	1'131 USD	86.85%	864'956.50	0.09	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'549	660	100	2'109 USD	80.97%	1'503'654.42	0.15	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	500	0	0	500 USD	97.80%	430'575.20	0.04	a)
US91282CCU36	0.1250 % T 0 1/8 08/31/23	583	0	583	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	680	400	0	1'080 USD	87.13%	828'627.82	0.08	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	800	220	0	1'020 USD	91.22%	819'291.24	0.08	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	541	0	0	541 USD	97.41%	464'040.11	0.05	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	630	400	0	1'030 USD	87.45%	793'099.69	0.08	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	819	250	0	1'069 USD	91.33%	859'678.90	0.09	a)
US91282CDA62	0.2500 % T 0 1/4 09/30/23	572	0	572	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	497	0	0	497 USD	97.20%	425'376.20	0.04	a)
US91282CDD02	0.3750 % T 0 3/8 10/31/23	419	0	419	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	966	0	0	966 USD	87.80%	746'876.60	0.08	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	530	420	0	950 USD	91.66%	766'725.16	0.08	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	647	0	0	647 USD	96.96%	552'401.83	0.06	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	1'506	440	0	1'946 USD	81.19%	1'391'188.65	0.14	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	944	150	0	1'094 USD	91.78%	884'148.70	0.09	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	900	240	0	1'140 USD	88.16%	885'014.67	0.09	a)
US91282CDM01	0.5000 % T 0 1/2 11/30/23	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	715	0	0	715 USD	96.81%	609'524.97	0.06	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	592	320	0	912 USD	87.44%	702'176.99	0.07	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	500	470	0	970 USD	91.63%	782'599.82	0.08	a)
US91282CDR97	0.7500 % T 0 3/4 12/31/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	720	0	0	720 USD	96.64%	612'672.94	0.06	a)
US91282CDV00	0.8750 % T 0 7/8 01/31/24	471	0	471	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	803	100	0	903 USD	88.90%	706'864.07	0.07	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	1'426	490	150	1'766 USD	83.98%	1'306'000.11	0.13	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	756	0	0	756 USD	96.64%	643'306.58	0.07	a)
US91282CEA53	1.5000 % T 1 1/2 02/29/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	540	300	0	840 USD	89.30%	660'552.84	0.07	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	862	150	0	1'012 USD	92.91%	827'972.64	0.08	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	667	0	0	667 USD	96.68%	567'848.71	0.06	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	450	330	0	780 USD	91.39%	627'697.32	0.06	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	560	300	0	860 USD	94.56%	716'096.28	0.07	a)
US91282CEG24	2.2500 % T 2 1/4 03/31/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	761	0	0	761 USD	97.43%	652'901.10	0.07	a)
US91282CEK36	2.5000 % T 2 1/2 04/30/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	739	150	0	889 USD	93.58%	732'537.94	0.07	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	773	120	0	893 USD	95.15%	748'181.81	0.08	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	1'383	470	140	1'713 USD	90.41%	1'363'671.74	0.14	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	450	0	0	450 USD	97.46%	386'171.05	0.04	a)
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	480	260	0	740 USD	92.90%	605'332.72	0.06	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	792	120	120	792 USD	94.67%	660'237.49	0.07	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	583	0	0	583 USD	97.48%	500'406.32	0.05	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	450	240	0	690 USD	95.13%	578'007.47	0.06	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	775	150	0	925 USD	96.52%	786'191.85	0.08	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	480	180	0	660 USD	97.55%	566'929.04	0.06	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	703	130	0	833 USD	94.86%	695'791.76	0.07	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	632	150	120	662 USD	92.13%	537'018.83	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	480	120	0	600 USD	97.63%	515'802.80	0.05	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	1'344	400	0	1'744 USD	89.28%	1'371'073.59	0.14	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	748	150	0	898 USD	95.97%	758'857.44	0.08	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	350	330	0	680 USD	94.38%	565'139.75	0.06	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	450	200	0	650 USD	98.08%	561'357.50	0.06	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	653	0	120	533 USD	98.02%	460'019.82	0.05	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	728	0	0	728 USD	99.20%	635'882.03	0.07	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	646	0	0	646 USD	99.19%	564'235.73	0.06	a)
US91282CFQ96	4.3750 % T 4 3/8 10/31/24	702	0	0	702 USD	99.43%	614'644.88	0.06	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	400	240	0	640 USD	98.59%	555'627.05	0.06	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	715	0	0	715 USD	99.19%	624'477.81	0.06	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	1'340	340	0	1'680 USD	98.95%	1'463'837.33	0.15	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	530	0	0	530 USD	99.61%	464'868.49	0.05	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	556	0	0	556 USD	99.46%	486'965.75	0.05	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	611	0	0	611 USD	97.98%	527'129.63	0.05	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	747	0	0	747 USD	98.34%	646'876.52	0.07	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	677	0	0	677 USD	98.78%	588'866.98	0.06	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	420	250	120	550 USD	97.95%	474'351.60	0.05	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	400	330	0	730 USD	98.34%	632'104.89	0.06	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	450	0	0	450 USD	99.27%	393'368.52	0.04	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	530	140	0	670 USD	98.58%	581'579.89	0.06	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	586	0	0	586 USD	99.13%	511'507.44	0.05	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	751	0	0	751 USD	97.00%	641'454.26	0.07	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	616	0	0	616 USD	95.96%	520'510.17	0.05	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	530	200	0	730 USD	98.81%	635'168.23	0.06	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	555	1'500	250	1'805 USD	94.34%	1'499'492.72	0.15	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	615	0	0	615 USD	99.58%	539'253.64	0.06	a)
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	747	0	0	747 USD	98.77%	649'702.88	0.07	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	583	0	0	583 USD	98.52%	505'780.56	0.05	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	0	800	0	800 USD	100.00%	704'440.00	0.07	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	0	650	0	650 USD	96.52%	552'459.14	0.06	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	0	760	0	760 USD	97.39%	651'755.59	0.07	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	0	250	0	250 USD	98.80%	217'506.17	0.02	a)
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	0	600	0	600 USD	98.30%	519'373.16	0.05	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	0	820	120	700 USD	95.81%	590'573.88	0.06	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	0	820	0	820 USD	96.91%	699'712.55	0.07	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	0	600	0	600 USD	98.03%	517'928.50	0.05	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	1'830	0	1'830 USD	93.31%	1'503'643.69	0.15	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	0	820	0	820 USD	97.35%	702'927.94	0.07	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	0	650	100	550 USD	97.10%	470'265.30	0.05	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	0	650	0	650 USD	99.07%	567'036.36	0.06	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	0	720	0	720 USD	97.08%	615'471.43	0.06	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	0	720	0	720 USD	98.80%	626'368.24	0.06	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	0	400	0	400 USD	99.68%	351'091.80	0.04	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	0	680	0	680 USD	99.92%	598'306.21	0.06	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	0	760	0	760 USD	99.30%	664'512.56	0.07	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	660	120	540 USD	98.45%	468'141.66	0.05	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	1'990	190	1'800 USD	97.02%	1'537'687.95	0.16	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	0	720	0	720 USD	99.67%	631'915.70	0.06	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	0	650	0	650 USD	99.11%	567'259.94	0.06	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	0	800	0	800 USD	100.32%	706'696.41	0.07	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	0	750	0	750 USD	100.29%	662'321.51	0.07	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	0	720	0	720 USD	101.97%	646'477.80	0.07	a)
US91282CJA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	0	920	120	800 USD	101.35%	713'960.95	0.07	a)
US91282CJC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	0	800	0	800 USD	100.34%	706'806.48	0.07	a)
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	0	700	0	700 USD	100.39%	618'792.76	0.06	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	0	970	0	970 USD	102.45%	875'019.74	0.09	a)
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	0	650	0	650 USD	103.41%	591'853.43	0.06	a)
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	0	2'010	0	2'010 USD	101.91%	1'803'644.33	0.18	a)
US91282CJL80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	0	950	100	850 USD	100.38%	751'274.25	0.08	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	0	1'000	0	1'000 USD	100.25%	882'716.98	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	0	650	0	650 USD	100.56%	575'577.01	0.06	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	0	930	0	930 USD	100.43%	822'430.27	0.08	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	0	920	150	770 USD	99.80%	676'699.24	0.07	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	0	800	0	800 USD	96.92%	682'756.46	0.07	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	0	1'050	0	1'050 USD	97.73%	903'630.04	0.09	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	0	370	0	370 USD	98.84%	322'036.40	0.03	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	0	700	0	700 USD	98.39%	606'465.06	0.06	a)
US91324PEB40	0.5500 % UNH 0.55 05/15/24	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEF53	3.2500 % UNH 3 1/4 05/15/51	50	0	50	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US913366KW93	4.5630 % 913366KW9	0	150	0	150 USD	91.09%	120'313.82	0.01	a)
US917288BK78	4.3750 % URUGUA 4 3/8 01/23/31	50	0	0	50 USD	97.37%	42'869.58	0.00	a)
US96122WAM29	3.1500 % WSTP 3.15 01/16/24 144A	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USD4546MLM53	3.8750 % KFW 3 7/8 06/15/28	0	60	0	60 USD	97.84%	51'692.34	0.01	a)
USG10367AH66	5.0000 % BERMUD 5 07/15/32 REGS	0	200	0	200 USD	96.09%	169'224.10	0.02	a)
USG82016AS83	2.3000 % SINOPE 2.3 01/08/31 REGS	200	0	0	200 USD	86.04%	151'516.24	0.02	a)
USG8201NAC68	3.6250 % SINOPE 3 5/8 04/12/27 REGS	0	200	0	200 USD	96.30%	169'585.12	0.02	a)
USG8450LAJ38	3.5000 % CHGRID 3 1/2 05/04/27 REGS	200	0	0	200 USD	95.92%	168'928.23	0.02	a)
USG8850LAC49	3.1500 % YANTZE 3.15 06/02/26 REGS	200	0	0	200 USD	95.86%	168'819.05	0.02	a)
USP30179BK34	3.8750 % CFELEC 3 7/8 07/26/33 REGS	0	200	0	200 USD	81.82%	144'100.25	0.01	a)
USP3143NBF08	3.7000 % CDEL 3.7 01/30/50 REGS	200	0	0	200 USD	67.47%	118'826.70	0.01	a)
USP3143NBK92	3.7500 % CDEL 3 3/4 01/15/31 REGS	0	200	0	200 USD	88.18%	155'295.56	0.02	a)
USP37110AS59	6.1500 % ENAPCL 6.15 05/10/33 REGS	0	200	0	200 USD	99.69%	175'560.54	0.02	a)
USP6629MAD40	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 07/31/47 REGS	200	0	0	200 USD	83.07%	146'289.29	0.01	a)
USP90603AN40	3.7500 % PANAMA 3 3/4 04/17/26 REGS	120	0	0	120 USD	94.30%	99'646.21	0.01	a)
USY20721BM04	5.1250 % INDON 5 1/8 01/15/45 REGS	200	0	0	200 USD	97.42%	171'562.84	0.02	a)
USY20721BN86	4.7500 % INDON 4 3/4 01/08/26 REGS	200	0	0	200 USD	99.65%	175'498.90	0.02	a)
USY57542AA32	2.0700 % MALAYS 2.07 04/28/31 REGS	250	0	0	250 USD	85.10%	187'343.62	0.02	a)
USY68856AT38	3.5000 % PETMK 3 1/2 04/21/30 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51085738729	5.1250 % PORTUG 5 1/8 10/15/24 144A	50	0	0	50 USD	99.74%	43'910.83	0.00	a)
X51227947097	4.0000 % CHGDN 4 05/19/25	200	0	0	200 USD	98.24%	173'008.70	0.02	a)
X51402929746	3.1250 % ADGB 3 1/8 05/03/26 REGS	200	0	0	200 USD	96.27%	169'534.05	0.02	a)
X51405781854	4.6250 % QATAR 4 5/8 06/02/46 REGS	0	200	0	200 USD	91.26%	160'719.75	0.02	a)
X51508675417	3.2500 % KSA 3 1/4 10/26/26 REGS	200	0	0	200 USD	95.45%	168'088.19	0.02	a)
X51508675508	4.5000 % KSA 4 1/2 10/26/46 REGS	200	0	0	200 USD	83.87%	147'701.70	0.02	a)
X51692177774	4.3750 % ORIEAS 4 3/8 12/21/27 EMTN	200	0	0	200 USD	95.29%	167'811.70	0.02	a)
X51696899035	4.1250 % ADGB 4 1/8 10/11/47 REGS	0	200	0	200 USD	83.39%	146'865.17	0.02	a)
X51788513734	5.1250 % HAOUA 5 1/8 03/14/28	0	200	0	200 USD	99.00%	174'343.62	0.02	a)
X51791939066	4.5000 % KSA 4 1/2 04/17/30 REGS	200	0	0	200 USD	96.99%	170'809.09	0.02	a)
X51811821211	4.7500 % CHIOLI 4 3/4 04/26/28	200	0	0	200 USD	96.90%	170'654.11	0.02	a)
X51837994794	5.1250 % ROMANI 5 1/8 06/15/48 REGS	60	0	0	60 USD	83.17%	43'939.09	0.00	a)
X51936302865	4.3750 % KSA 4 3/8 04/16/29 REGS	0	200	0	200 USD	97.01%	170'851.36	0.02	a)
X51936302949	5.2500 % KSA 5 1/4 01/16/50 REGS	200	0	0	200 USD	92.23%	162'426.25	0.02	a)
X51959337749	4.8170 % QATAR 4.817 03/14/49 REGS	200	0	0	200 USD	92.55%	162'986.28	0.02	a)
X51982113208	3.5000 % ARAMCO 3 1/2 04/16/29 REGS	0	200	0	200 USD	92.94%	163'667.83	0.02	a)
X51982116136	4.3750 % ARAMCO 4 3/8 04/16/49 REGS	0	200	0	200 USD	81.46%	143'457.44	0.01	a)
X52084425110	2.1250 % CHINA 2 1/8 12/03/29	0	200	0	200 USD	89.45%	157'525.11	0.02	a)
X52101346208	1.7500 % RENTEN 1 3/4 01/14/27 EMTN	60	0	0	60 USD	92.51%	48'873.17	0.00	a)
X52114850949	2.7500 % QNBK 2 3/4 02/12/27 EMTN	0	200	0	200 USD	93.22%	164'173.26	0.02	a)
X52125308168	3.1250 % ADGB 3 1/8 04/16/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.50%	161'137.13	0.02	a)
X52125308242	3.8750 % ADGB 3 7/8 04/16/50 REGS	200	0	0	200 USD	79.28%	139'627.05	0.01	a)
X52155352664	3.7500 % QATAR 3 3/4 04/16/30 REGS	200	0	0	200 USD	95.49%	168'163.92	0.02	a)
X52175968580	3.9500 % MUBAUH 3.95 05/21/50 GMTN	0	200	0	200 USD	78.43%	138'123.07	0.01	a)
X52176021223	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 05/21/30 GMTN	200	0	0	200 USD	88.80%	156'385.68	0.02	a)
X52177023137	0.6250 % NRWK 0 5/8 05/19/25 EMTN	0	60	0	60 USD	94.72%	50'043.42	0.01	a)
X52185867160	1.8750 % STSP 1 7/8 06/10/30 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52187525196	0.7500 % IDAWBG 0 3/4 06/10/27 GDIF	50	0	0	50 USD	88.57%	38'994.28	0.00	a)
X52242422397	3.5000 % KZOKZ 3 1/2 04/14/33 REGS	200	0	0	200 USD	81.40%	143'357.06	0.01	a)
X52280637039	3.7500 % MEX 3 3/4 04/19/2071	0	200	0	200 USD	63.02%	110'977.48	0.01	a)
X52291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	200	0	0	200 USD	92.24%	162'445.63	0.02	a)
X52297244878	0.6250 % IDBINV 0 5/8 02/10/26 EMTN	100	0	0	100 USD	92.18%	81'164.70	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
XS2298321667	0.2500 % LBANK 0 1/4 02/12/24 EMTN	40	0	40	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2307309893	1.0000 % RENTEN 1 02/25/28 EMTN	0	50	0	50 USD	87.46%	38'507.33	0.00	a)
XS2318745937	1.2620 % ISDB 1.262 03/31/26	200	0	0	200 USD	92.92%	163'637.89	0.02	a)
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	50	0	0	50 USD	92.31%	40'640.46	0.00	a)
XS2333676729	1.0000 % NRW 1 04/21/26 EMTN	100	0	0	100 USD	92.39%	81'351.37	0.01	a)
XS2337430461	2.6250 % EQPTRC 2 5/8 04/28/28 REGS	200	0	0	200 USD	88.96%	156'670.98	0.02	a)
XS2359548935	3.1250 % QPETRO 3 1/8 07/12/41 REGS	200	0	0	200 USD	73.33%	129'146.75	0.01	a)
XS2366704497	0.6250 % NEWDEV 0 5/8 07/22/24 EMTN	200	0	0	200 USD	97.96%	172'520.88	0.02	a)
XS2388586401	2.1250 % REPHUN 2 1/8 09/22/31 REGS	200	0	0	200 USD	78.17%	137'666.95	0.01	a)
XS2393958488	2.2500 % ICBCIL 2 1/4 11/02/26 EMTN	0	200	0	200 USD	92.36%	162'648.15	0.02	a)
XS2434895988	3.0000 % ROMANI 3 02/27/27 REGS	60	0	0	60 USD	93.04%	49'157.94	0.01	a)
XS2434896010	3.6250 % ROMANI 3 5/8 03/27/32 REGS	100	0	0	100 USD	84.50%	74'406.48	0.01	a)
XS2437371763	1.3750 % LBANK 1 3/8 01/27/25 EMTN	60	0	0	60 USD	96.62%	51'046.19	0.01	a)
XS2492384818	4.0500 % UAE 4.05 07/07/32 REGS	200	0	0	200 USD	95.69%	168'510.85	0.02	a)
XS2548892020	5.5000 % KSA 5 1/2 10/25/32 REGS	200	0	0	200 USD	102.62%	180'720.56	0.02	a)
XS2549908684	4.5000 % ICBCAS 4 1/2 01/19/26 GMTN	0	200	0	200 USD	98.89%	174'160.46	0.02	a)
XS2571922884	6.6250 % ROMANI 6 5/8 02/17/28 REGS	0	60	0	60 USD	102.91%	54'372.03	0.01	a)
XS2571924070	7.6250 % ROMANI 7 5/8 01/17/53 REGS	0	40	0	40 USD	109.13%	38'436.36	0.00	a)
XS2577134401	4.7500 % KSA 4 3/4 01/18/28 REGS	200	0	0	200 USD	99.21%	174'725.78	0.02	a)
XS2585988061	4.8750 % PIFKSA 4 7/8 02/14/35	0	200	0	200 USD	94.69%	166'760.32	0.02	a)
XS2589321020	4.5980 % ISDB 4.598 03/14/28	0	200	0	200 USD	99.64%	175'472.48	0.02	a)
XS2596437918	4.8750 % LBANK 4 7/8 03/09/26 EMTN	0	60	0	60 USD	100.06%	52'864.70	0.01	a)
XS2623522930	4.5000 % CCB 4 1/2 05/31/26 EMTN	0	200	0	200 USD	98.90%	174'176.31	0.02	a)
XS2625985515	4.5000 % BOCAVI 4 1/2 05/23/28 GMTN	0	200	0	200 USD	97.35%	171'446.61	0.02	a)
XS2627035178	3.8750 % NRWK 3 7/8 05/26/26	0	100	0	100 USD	98.05%	86'336.17	0.01	a)
XS2632485897	4.6250 % BCHINA 4 5/8 06/26/26 EMTN	0	200	0	200 USD	99.07%	174'468.65	0.02	a)
XS2651081304	5.3750 % ADCBUH 5 3/8 07/18/28 GMTN	0	200	0	200 USD	100.92%	177'728.45	0.02	a)
XS2711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	0	200	0	200 USD	103.80%	182'805.70	0.02	a)
XS2747599509	5.7500 % KSA 5 3/4 01/16/54 REGS	0	200	0	200 USD	96.65%	170'215.60	0.02	a)
XS2756521303	6.3750 % ROMANI 6 3/8 01/30/34 REGS	0	60	0	60 USD	99.44%	52'537.66	0.01	a)

USD **205'632'520.24** **21.03**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen **113'222'011.02** **11.58**

IE00BZ6V7883	ISHARES US MBS UCITS ETF	17'571'062	16'003'546	1'816'800	31'757'808 USD	4.05	113'222'011.02	11.58	a)
--------------	--------------------------	------------	------------	-----------	----------------	------	----------------	-------	----

USD **113'222'011.02** **11.58**

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

282'480'281.68 **28.89**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen **282'480'281.68** **28.89**

CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	139'006	186'320	12'959	312'368 CNY	1'101.46	42'047'501.96	4.30	a)
--------------	----------------------------------	---------	---------	--------	-------------	----------	---------------	------	----

CNY **42'047'501.96** **4.30**

CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	205'072	187'348	18'351	374'069 EUR	118.99	42'413'294.81	4.34	a)
--------------	--	---------	---------	--------	-------------	--------	---------------	------	----

EUR **42'413'294.81** **4.34**

CH0383288252	SWC (CH) INDEX BF JAPAN GOVT. ST	787	670	59	1'398 JPY	9'335'167.41	76'793'633.06	7.85	a)
--------------	----------------------------------	-----	-----	----	-----------	--------------	---------------	------	----

JPY **76'793'633.06** **7.85**

CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	589'990	538'995	58'453	1'070'531 USD	128.60	121'225'851.85	12.40	a)
--------------	--	---------	---------	--------	---------------	--------	----------------	-------	----

USD **121'225'851.85** **12.40**

Derivative Finanzinstrumente **4'776.46** **0.00**

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall 05.04.2023	1'541'515	1'530'000		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 05.04.2023	336'418	380'000		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 05.04.2023	2'189'326	2'000'000		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall 06.04.2023	5'712'782	760'000		CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall 04.05.2023	1'820'437	240'000		DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 04.05.2023	6'291'958	5'600'000		USD/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 04.05.2023		359'746	240'000		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		2'605'113	2'560'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.05.2023		3'000'000	386'622		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 10.05.2023		602'193	400'000		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 10.05.2023		488'529	480'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.05.2023		2'481'024	320'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		2'400'000	2'463'277		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		300'000	507'265		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		4'000'000	4'377'455		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		560'000	832'986		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		1'050'000	160'473'902		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		480'000	423'802		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		3'637'012	3'550'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		3'252'323	400'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		6'818'423	6'100'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		750'000	733'052		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		60'000'000	372'273		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		390'000	443'531		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2023		100'000	22'007		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		900'000	539'105		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		1'500'000	185'475		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		850'000	761'779		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		1'778'720	1'700'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		6'922'036	6'000'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		278'609'966	1'700'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		20'601'226	2'500'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		3'400'000	3'850'008		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		1'950'000	16'071'605		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		1'440'000	1'502'360		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		250'000	223'409		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		850'000	140'104'732		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		41'286'487	250'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		1'151'041	140'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		282'770	250'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		261'658	250'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		7'800'000	8'527'824		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		250'000	373'049		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		3'700'000	603'557'400		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.10.2023		170'000	3'230'582		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		3'850'000	3'975'478		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		1'340'000	1'200'310		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		250'000	2'969'333		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/USD Verfall 19.10.2023		395'878	540'000		USD/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		1'143'522	1'100'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		8'873'329	1'100'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		4'505'292	4'100'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.11.2023		543'511	600'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		141'415'654	850'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		844'871	930'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		6'716'496	5'840'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		857'621	550'000		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		220'992'597	1'300'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		10'675'426	1'300'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		3'162'092	3'000'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		435'116	280'000		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		1'554'083	1'480'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		253'792	280'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		155'862'726	920'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2023		5'571'241	280'000		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		4'496'954	550'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		3'387'615	2'960'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.12.2023		2'648'834	2'280'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.12.2023		296'406	280'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 27.12.2023		3'817'047	460'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 28.12.2023		660'000	424'915		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 28.12.2023		590'000	343'075		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.12.2023		6'980'000	5'980'827		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 28.12.2023		3'180'000	2'994'581		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 28.12.2023		1'540'000	130'509		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 28.12.2023		2'870'000	144'260		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 28.12.2023		470'000	509'618		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 28.12.2023		10'250'000	1'229'385		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 28.12.2023		238'000'000	1'434'609		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		262'181	280'000		GBP/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/CNY Verfall 04.01.2024		3'231'925	380'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		299'086	190'000	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		807'501	750'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		887'734	190'000	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		11'715'752	9'860'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		438'068	470'000	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		877'365	560'000	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		18'949'327	2'240'000	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		3'506'545	3'260'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		884'531	810'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		519'907	810'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		280'000	493'898	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		2'300'000	391'876'235	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		2'050'557	17'150'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		6'700'000	7'813'156	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		1'050'000	1'127'142	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		340'603	300'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.02.2024		34'111'531	200'000	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 21.02.2024		210'817	200'000	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		2'500'000	424'933'031	CHF/JPY		-517.44	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		290'000	505'847	CHF/AUD		76.77	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		2'200'000	18'004'010	CHF/CNY		-176.31	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		770'000	1'186'249	CHF/CAD		275.49	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		5'370'000	5'636'109	CHF/EUR		1'298.98	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		1'050'000	942'824	CHF/GBP		387.77	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		8'900'000	10'108'881	CHF/USD		3'431.20	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							4'776.46	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF Verfall 05.04.2023	302'880'886	324'401'000	CHF/USD	0.00	0.00
SGD/CHF Verfall 05.04.2023	1'108'511	1'597'000	CHF/SGD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 05.04.2023	2'293'835	25'578'000	CHF/SEK	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 05.04.2023	1'753'379	3'031'000	CHF/NZD	0.00	0.00
DKK/CHF Verfall 05.04.2023	1'265'587	9'491'000	CHF/DKK	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 05.04.2023	17'670'014	25'758'000	CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 05.04.2023	25'614'007	22'646'000	CHF/GBP	0.00	0.00
MXN/CHF Verfall 05.04.2023	2'035'335	40'209'000	CHF/MXN	0.00	0.00
ILS/CHF Verfall 05.04.2023	771'057	3'014'000	CHF/ILS	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 05.04.2023	81'163'619	11'785'030'000	CHF/JPY	0.00	0.00
NOK/CHF Verfall 05.04.2023	454'521	5'028'000	CHF/NOK	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 05.04.2023	142'264'974	143'389'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CZK/CHF Verfall 05.04.2023	927'525	22'075'000	CHF/CZK	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 05.04.2023	10'343'413	16'409'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CNY/CHF Verfall 05.04.2023	59'068'303	438'915'000	CHF/CNY	0.00	0.00
PLN/CHF Verfall 05.04.2023	1'070'956	5'102'000	CHF/PLN	0.00	0.00
THB/CHF Verfall 05.04.2023	2'096'243	79'301'000	CHF/THB	0.00	0.00
AUD/CHF Verfall 05.04.2023	21'547	34'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF Verfall 05.04.2023	620'154	901'000	CHF/CAD	0.00	0.00
CNY/CHF Verfall 05.04.2023	24'285	178'000	CHF/CNY	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 05.04.2023	285'261	285'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF Verfall 05.04.2023	552'215	491'000	CHF/GBP	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 05.04.2023	343'818	49'774'000	CHF/JPY	0.00	0.00
NOK/CHF Verfall 05.04.2023	203'401	2'256'000	CHF/NOK	0.00	0.00
NZD/CHF Verfall 05.04.2023	8'224	14'000	CHF/NZD	0.00	0.00
SEK/CHF Verfall 05.04.2023	200'417	2'282'000	CHF/SEK	0.00	0.00
SGD/CHF Verfall 05.04.2023	271'530	389'000	CHF/SGD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.04.2023	1'182'133	1'263'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR Verfall 05.04.2023	243'000	241'608	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 05.04.2023	265'000	246'320	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY Verfall 05.04.2023	92'000	12'346	CNY/CHF	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 05.04.2023	143'485	20'902'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 05.04.2023	208'425	213'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CNY/CHF Verfall 05.04.2023	229'326	1'729'000	CHF/CNY	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 05.04.2023	141'649	20'812'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.04.2023	225'082	247'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/GBP Verfall 05.04.2023	15'000	16'971	GBP/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.04.2023	603'759	657'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF Verfall 05.04.2023	105'538	106'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF Verfall 05.04.2023	146'550	21'114'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CHF/CAD Verfall 05.04.2023	17'000	11'501	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY Verfall 05.04.2023	290'000	38'702	CNY/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/AUD Verfall 05.04.2023		16'443'000	10'059'170	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.04.2023		5'102'000	1'081'670	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2023		11'897'632'000	81'663'680	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.04.2023		26'642'000	17'981'085	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2023		326'303'000	298'039'613	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.04.2023		22'075'000	933'176	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2023		23'122'000	26'113'201	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.04.2023		27'860'000	2'454'104	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.04.2023		9'491'000	1'264'457	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.04.2023		7'284'000	635'281	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.04.2023		440'440'000	58'585'127	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.04.2023		40'209'000	2'033'622	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.04.2023		3'045'000	1'740'126	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.04.2023		3'014'000	764'595	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2023		1'986'000	1'364'426	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2023		143'750'000	142'653'188	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 05.04.2023		79'301'000	2'118'447	THB/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.04.2023		7'527'739	10'657'901'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.04.2023		10'657'901'000	7'462'847	KRW/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.05.2023		1'099'445	5'212'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.05.2023		149'777	708'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.05.2023		7'537	35'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		10'333'799	16'928'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		18'292'663	27'179'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		305'452'384	335'478'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 03.05.2023		946'600	22'499'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		27'129'620	24'083'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		2'480'489	28'205'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		1'283'020	9'643'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		641'675	7'371'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		2'068'763	41'271'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2023		1'772'278	3'111'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		770'409	3'045'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		1'398'267	2'040'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		146'308'406	147'658'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		6'312	126'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		118'522	105'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		178'626	264'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		302'676	490'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		3'431'852	3'772'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		1'166'835	1'176'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		5'063	20'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		6'771'572	7'504'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		3'806'618	3'861'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		264'182	235'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		235'836	389'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		519'467	775'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		348'409	312'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		224'363	228'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		37'600	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		1'997	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		164'294	246'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		1'964'673	2'202'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		811'952	826'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		276'599	249'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		71'306	823'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		141'840	2'884'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		273'559	278'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		8'000	8'939	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		217'140	242'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		9'000	6'012	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		5'000	3'018	AUD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		2'214	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		1'319	2'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		433'911	486'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		217'601	222'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		563'105	862'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		6'765'279	7'603'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		3'125'059	3'179'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		44'113	75'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		663'677	598'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 03.05.2023		5'716	136'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		3'704	44'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		4'439	18'000	CHF/ILS		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		13'291	268'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		69'825	106'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		578'569	586'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		37'370	63'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		8'047	12'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2023		9'890	18'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		7'683	58'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		106'202	95'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		1'180'804	1'317'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		15'218	175'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		29'203'000	2'533'506		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		12'809'392'000	83'722'186		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.05.2023		5'955'000	1'277'222		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		9'701'000	1'278'752		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		17'940'000	10'550'550		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		2'052'000	1'368'760		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		25'671'000	28'718'019		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		158'014'000	155'252'389		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.05.2023		3'083'000	754'620		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.05.2023		44'549'000	2'197'175		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 03.05.2023		22'635'000	947'184		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.05.2023		480'699'000	61'793'856		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		29'428'000	19'308'653		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		358'646'000	319'153'696		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.05.2023		7'415'000	617'269		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		3'129'000	1'719'824		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		59'561'616	448'226'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.05.2023		2'159'576	81'015'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		764'358	5'769'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		1'430'290	10'886'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		144'123	1'106'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		383'801	2'951'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.05.2023		154'000	20'054		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		137'081	1'059'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		1'158'458	9'025'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.05.2023		236'607	1'831'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.05.2023		12'898	491'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 04.05.2023		81'506'000	2'124'617		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 04.05.2023		7'604'993	10'884'258'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 04.05.2023		10'884'258'000	7'281'253		KRW/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		83'269'050	12'117'643'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.05.2023		81'313'000	561'570		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		2'023'428	292'443'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		216'874	32'189'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		653'758	97'551'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.05.2023		4'100'000	27'349		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		6'889	1'036'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		2'048'437	306'666'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		316'165	47'277'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.06.2023		1'605'991	2'414'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		3'073'000	751'966		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		2'414'000	1'628'919		SGD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		2'540'976	29'350'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		85'170'139	13'018'717'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		1'284'432	6'022'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		10'554'369	17'988'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		28'201'217	25'284'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		156'690'362	159'774'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		749'966	3'073'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		2'194'760	44'965'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.06.2023		947'643	22'765'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		63'065'101	491'188'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		19'321'042	29'538'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		324'129'489	365'585'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		615'957	7'415'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		2'060'368	2'102'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		8'056	164'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		4'092'028	4'592'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		8'039	93'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		304'346	512'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		393'561	3'057'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		260'000	234'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		1'336'435	203'737'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		276'812	423'000		CHF/CAD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		367'757	555'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		449'464	400'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		456'225	465'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		50'722	57'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		299'342	2'323'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		18'646	2'815'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		388'733	58'841'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		657'694	740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		161'244	1'848'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		401'789	412'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		6'731	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		14'918	116'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		38'000'000	252'131		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		14'760	2'247'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		294'494	2'300'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		55'452	62'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		26'266	27'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		1'789	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		291'915	439'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		292'977	262'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		1'995	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		442'235	67'917'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		3'353	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		527'457	542'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		262'043	290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		7'934	62'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		163'322'000	159'152'961		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2023		31'291'000	2'628'037		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2023		30'958'000	20'816'159		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2023		18'503'000	10'944'728		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		371'326'000	339'473'656		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2023		7'415'000	608'304		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.06.2023		22'765'000	932'964		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		13'316'274'000	87'145'159		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2023		499'046'000	64'019'118		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		26'189'000	29'666'611		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.06.2023		45'129'000	2'320'687		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2023		6'022'000	1'293'583		PLN/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.06.2023		7'760'249	11'623'790'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.06.2023		11'623'790'000	7'976'387		KRW/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.06.2023		1'488'671	11'312'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.06.2023		2'117'022	81'449'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.06.2023		1'742'708	3'183'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.06.2023		324'229	12'443'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.06.2023		11'837	90'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.06.2023		11'402'000	1'492'066		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.06.2023		3'183'000	1'743'297		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.06.2023		93'892'000	2'466'421		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 04.07.2023		26'165'000	1'074'937		CZK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		156'478'234	160'868'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2023		1'488'002	11'388'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		19'778'114	29'498'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		2'611'673	31'157'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		10'464'035	17'734'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		329'415'787	361'764'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.07.2023		605'184	7'393'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2023		752'835	3'084'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.07.2023		1'609'243	2'949'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		86'121'039	13'144'317'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.07.2023		2'447'038	93'382'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2023		1'617'916	2'404'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		64'301'004	501'791'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		27'847'867	24'656'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.07.2023		1'290'232	6'039'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		2'312'331	45'433'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		7'184	86'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		91'664	718'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		108'014	161'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		1'179'934	1'303'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2023		7'322	56'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		220'086	194'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		96'742	14'773'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		46'363	78'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		473'122	486'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		442'615	68'309'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		293'983	2'329'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		2'704	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		3'397	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		49'484	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		240'338	248'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		403'202	354'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		228'403	4'377'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		1'526'756	235'556'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		322'190	474'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		949'358	7'518'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		4'884'846	5'408'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		2'556'545	2'617'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		16'569	27'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		184'602	2'196'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		462'409	3'685'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		422'033	471'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		1'364'000	1'335'929	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		258'000	294'987	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		8'337'000	1'042'617	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		2'877'000	2'582'697	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		116'398'000	740'663	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		197'000	133'476	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		8'000	7'817	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		107'000	96'011	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2023		196'000	25'816	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		32'000	36'520	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		176'000	172'618	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		385'013	430'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2023		103'000	22'744	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.07.2023		41'000	27'232	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.07.2023		50'000	27'648	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		512'000	347'971	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.07.2023		574'000	47'908	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		779'134	6'276'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2023		855'000	44'758	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		306'000	183'407	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		132'078	21'224'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.07.2023		93'382'000	2'356'495	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		366'447'000	327'785'009	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.07.2023		2'363'000	1'561'889	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		513'980'000	63'203'607	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		24'917'000	28'340'347	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		29'428'000	19'896'183	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.07.2023		3'084'000	743'543	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		13'367'781'000	82'743'222	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2023		5'936'000	1'306'810	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		17'533'000	10'441'445	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2023		11'248'000	1'474'568	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.07.2023		7'393'000	617'426	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2023		48'955'000	2'552'832	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.07.2023		32'865'000	2'722'405	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		162'671'000	158'753'232	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.07.2023		2'899'000	1'588'936	NZD/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 06.07.2023		7'774'045	11'360'018'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 06.07.2023		11'360'018'000	7'720'026	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 07.07.2023		932'687	22'875'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 07.07.2023		134'844	3'290'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		5'312	43'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.08.2023		2'321'089	92'125'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		329'358'449	369'303'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		1'561'455	2'367'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		63'836'694	519'572'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		28'251'637	24'907'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		19'725'587	29'251'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 04.08.2023		1'070'464	26'166'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		83'356'473	13'448'627'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		1'320'256	6'024'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		10'290'714	17'317'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		1'467'321	11'207'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		599'225	7'189'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		2'567'720	49'672'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2023		2'698'949	32'637'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		161'209'957	165'444'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		1'575'803	2'884'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		268'979	2'177'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		1'381'910	1'416'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 04.08.2023		71'687	1'747'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		149'944	222'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		177'634	28'589'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		416'037	696'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		367'475	324'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		22'347	102'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		3'793'822	4'246'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		354'377	525'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		12'672	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		224'333	197'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		26'854	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		6'937	1'115'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		752'899	1'151'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		4'534'256	4'719'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		1'210'151	1'076'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		108'463	841'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		240'107	406'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		3'012'781	484'296'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		8'966'449	10'456'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		1'688'376	14'052'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		530'892	618'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		333'170	345'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		149'185	2'914'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		118'170	137'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		16'000	15'274		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		50'000	6'036		CNY/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		147'913	687'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		1'322'000	8'132		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		102'686	156'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		267'858	240'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		216'770	227'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		45'168	52'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2023		41'000	23'963		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		73'000	6'047		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		1'163'000	140'964		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		30'295'000	186'411		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		336'058	351'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		12'248	101'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		6'695	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		665'372	767'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		244'373	39'513'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		385'609'000	334'213'876		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.08.2023		12'048'000	1'544'987		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.08.2023		2'367'000	1'545'147		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2023		18'378'000	10'733'891		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2023		31'305'000	20'615'970		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		32'564'000	2'686'074		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.08.2023		6'813'000	1'478'169		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 04.08.2023		92'125'000	2'333'618		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2023		52'586'000	2'728'335		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		13'970'523'000	85'235'837		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2023		26'750'000	29'829'674		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.08.2023		7'189'000	615'993		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		534'732'000	64'885'450		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 04.08.2023		27'913'000	1'111'453		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		172'499'000	164'847'548		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.08.2023		2'884'000	1'555'797		NZD/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 04.08.2023		8'328'220	12'286'456'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 04.08.2023		12'286'456'000	8'398'159		KRW/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		740'336	3'079'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.08.2023		3'079'000	728'421		ILS/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		337'492'047	390'775'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		1'545'354	12'071'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		1'543'273	2'369'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		728'176	3'086'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		10'773'957	18'492'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		20'351'567	31'001'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		2'717'466	33'011'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		1'490'432	6'906'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.09.2023		2'348'420	92'787'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		2'715'688	52'849'000		CHF/MXN	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		86'286'603	14'121'038'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		30'005'177	26'999'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		614'387	7'188'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		67'491'541	556'567'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 06.09.2023		1'141'419	28'526'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		166'476'738	174'546'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		1'546'014	2'876'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		4'068	19'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		45'231	69'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		86'975	1'707'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		60'122	105'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		23'769	185'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		374'787	3'080'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		38'251'000	234'508		JPY/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		3'721	7'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		148'488	1'822'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		748'359	782'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		2'342'585	2'679'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		301'771	272'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		526'745	4'343'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		7'977	37'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		80'604	84'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		277'808	45'110'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		151'666	233'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		72'155	83'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		155'293	140'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		745'304	6'177'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		5'744	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		13'197	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		19'479	3'234'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		65'068	74'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		153'483	237'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		151'096	653'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		410'051	428'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		4'544	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		458'349	3'806'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		6'716	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		69'601	79'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		252'185	41'843'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2023		21'000	13'605		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		129'774	117'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2023		13'000	7'379		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		264'357	277'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		402'000	48'618		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 06.09.2023		28'526'000	1'134'516		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.09.2023		7'188'000	596'784		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		176'123'000	168'830'627		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		6'962'000	1'491'859		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2023		34'833'000	2'809'839		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		393'705'000	347'718'681		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.09.2023		2'883'000	1'516'199		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.09.2023		12'256'000	1'576'428		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.09.2023		2'606'000	1'704'376		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		14'172'974'000	85'995'228		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2023		31'289'000	20'425'960		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.09.2023		54'556'000	2'862'248		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.09.2023		92'787'000	2'340'459		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2023		18'584'000	10'629'546		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2023		27'534'000	30'814'676		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.09.2023		3'739'000	869'461		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		573'571'000	69'608'003		CNY/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 06.09.2023		9'396'445	13'780'112'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 06.09.2023		13'780'112'000	9'158'046		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 29.09.2023		11'333'000	1'425'691		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.10.2023		555'102'000	69'704'158		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		19'052'000	11'249'063		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		31'606'000	21'384'683		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 04.10.2023		1'118'295	28'236'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.10.2023		596'380	7'199'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		166'810'832	174'312'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.10.2023		1'485'159	6'963'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		2'794'874	34'706'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		340'375'529	386'576'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.10.2023		1'499'074	2'859'000		CHF/NZD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		1'572'619	12'244'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		1'664'691	2'550'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		84'647'983	13'931'233'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		20'276'924	31'144'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.10.2023		2'791'062	53'629'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 04.10.2023		2'317'127	92'009'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		10'652'550	18'662'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		30'134'285	27'005'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.10.2023		868'035	3'741'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		27'343	48'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		3'266	5'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		875'634	918'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		194'065	32'003'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.10.2023		4'723	9'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		6'529	51'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		3'246	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		154'615	139'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		5'445	68'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		923'650	1'048'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.10.2023		5'632	110'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		301'706	271'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		2'602	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		22'815	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		275'732	311'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		161'713	26'819'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		167'307	27'447'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		27'571	31'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		264'074	276'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		29'000	32'281	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		355'290	371'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.10.2023		20'000	11'451	AUD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		147'656	24'371'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		138'996	211'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		163'051	183'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		7'000	7'783	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		363'998	406'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.10.2023		8'000	5'348	CAD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		128'905	21'191'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		260'821	272'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		13'012	2'121'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		25'105	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		440'775	483'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		170'029	250'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		259'998	269'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		219'771	197'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		212'245	362'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.10.2023		12'295'000	1'596'924	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.10.2023		34'774'000	2'928'214	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.10.2023		3'741'000	899'022	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.10.2023		2'868'000	1'576'327	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.10.2023		53'739'000	2'828'305	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		389'038'000	355'875'234	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		176'468'000	170'916'317	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 04.10.2023		92'009'000	2'312'214	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.10.2023		6'963'000	1'459'194	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.10.2023		2'555'000	1'712'461	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		27'576'000	30'788'714	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		14'065'185'000	86'233'368	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 04.10.2023		28'236'000	1'122'762	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.10.2023		7'199'000	618'941	NOK/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 04.10.2023		9'085'679	13'703'293'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 04.10.2023		13'703'293'000	9'257'668	KRW/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		68'099'746	562'501'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		149'625	1'233'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		2'428	20'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		255'223	2'095'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		610'000	74'716	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		149'000	18'296	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		167'676	1'345'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2023		7'129'000	1'539'493	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2023		49'724'000	2'506'582	MXN/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2023		1'551'490	11'965'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		2'673'889	31'818'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.11.2023		1'541'732	2'814'000	CHF/NZD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		69'005'981	550'647'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		2'585'765	49'542'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		338'132'095	370'828'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		161'779'063	167'364'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		10'818'376	18'362'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		1'450'493	6'950'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 03.11.2023		2'223'442	88'571'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		1'471'734	2'200'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		29'018'264	26'069'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 03.11.2023		1'095'703	27'678'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		20'031'525	29'689'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2023		610'847	7'122'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		234'360	211'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		9'445	182'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		52'316	78'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		3'340	5'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		10'000	5'845	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.11.2023		9'000	4'911	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		120'000	15'051	CNY/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2023		10'205	79'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		10'480	126'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2023		2'627	31'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		3'335	16'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		957'427	1'045'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		1'340'406	1'392'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		432'661	390'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		154'023	230'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		1'194'538	9'508'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		155'283	1'874'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		4'622'969	5'034'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		20'282	35'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		38'172	57'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		3'092'838	3'211'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		415'765	3'353'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		303'836	317'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		11'000	12'186	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		12'000	7'977	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		303'609	336'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		356'400	2'877'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		1'962'051	2'169'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		328'238	297'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		947'988	992'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		363'737	549'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		6'887	12'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		10'963	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		326'783	2'643'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		5'120	9'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		771'814	813'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		1'398'034	1'548'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 03.11.2023		156'117	4'058'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		166'668	252'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		110'000	104'668	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		1'211'817	1'348'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		16'000	17'524	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		352'000	43'257	CNY/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		34'990	163'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2023		1'784'000	147'059	SEK/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		144'848	253'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		494'000	325'694	CAD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		161'273	1'988'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		135'361	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		339'558	2'756'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		10'960	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		389'544	598'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		601'530	630'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		26'960'000	29'767'453	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		18'661'000	10'752'338	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 03.11.2023		31'736'000	1'241'750	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 03.11.2023		88'571'000	2'244'903	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		174'609'000	167'945'921	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.11.2023		12'044'000	1'552'050	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2023		34'022'000	2'770'599	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.11.2023		7'153'000	582'576	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.11.2023		2'805'000	1'484'552	NZD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		382'458'000	348'052'461		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		30'717'000	20'133'335		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.11.2023		2'435'000	1'617'308		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		571'312'000	70'812'408		CNY/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 03.11.2023		9'123'263	13'536'924'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 03.11.2023		13'536'924'000	9'061'381		KRW/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.11.2023		881'321	3'676'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		82'346'388	13'408'079'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		230'141'000	1'414'336		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		2'972'533	480'165'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		264'620	43'428'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		738'373	121'843'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		272'869	45'093'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		88'308'000	531'689		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		1'028'927	170'451'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		13'950'610'000	83'852'234		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.11.2023		3'676'000	826'806		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		3'632'000	847'988		ILS/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		30'021'758	27'278'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		10'552'154	18'357'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.12.2023		1'257'115	32'279'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.12.2023		1'560'246	12'130'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		169'177'658	176'264'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2023		2'779'220	34'202'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		83'623'081	13'892'308'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2023		584'388	7'193'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2023		1'482'281	2'810'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		345'744'875	381'231'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		807'869	3'600'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		20'204'105	30'917'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		1'543'902	7'177'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		2'484'454	49'722'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		71'874'626	580'608'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		1'615'312	2'437'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2023		7'000	3'703		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		123'694'000	747'029		JPY/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		7'238	32'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		40'000	4'957		CNY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		2'716	54'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		57'000	32'940		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		1'986'000	1'802'019		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		69'000	45'117		CAD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		3'425	16'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		106'712	97'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		506'000	484'379		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		551'504	91'553'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		524'863	586'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		345'497	359'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		16'732	136'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		157'408	142'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		8'105	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		218'035	334'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		86'218	150'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		2'114	355'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		3'854	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		12'000	6'932		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		169'307	28'803'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		63'469	98'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		125'493	114'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		132'682	150'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		188'523	196'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		401'000	48'952		CNY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		164'242	149'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		949'179	160'759'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2023		22'325	274'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		144'434	224'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		1'877'700	1'947'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		23'003	449'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		136'791	238'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		3'528'108	3'982'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		489'625	4'002'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		157'629	239'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		2'021'116	2'096'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		3'494'250	3'964'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		958'951	160'510'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		14'464	25'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		420'035	380'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		407'021	632'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		502'193	4'064'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2023		171'563	2'033'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		4'873'685	5'531'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		1'202'042	203'728'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		100'917	819'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		257'762	444'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		28'507	44'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		2'484'929	2'577'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		433'517	390'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		19'145'000	11'036'939		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2023		12'130'000	1'543'482		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.12.2023		7'467'000	602'251		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		14'414'322'000	84'784'321		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		589'188'000	71'742'477		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.12.2023		36'235'000	3'006'255		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.12.2023		2'676'000	1'743'363		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		182'937'000	173'541'173		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		32'180'000	20'635'393		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2023		50'225'000	2'513'289		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.12.2023		7'193'000	1'567'261		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.12.2023		32'279'000	1'257'235		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		393'467'000	342'088'473		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2023		2'803'000	1'505'205		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		28'550'000	31'423'272		GBP/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.12.2023		8'906'043	13'330'441'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.12.2023		13'330'441'000	8'985'053		KRW/CHF	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.12.2023		2'235'626	88'343'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 06.12.2023		232'672	9'350'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 06.12.2023		97'693'000	2'414'483		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		14'993'812'000	89'508'560		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		11'478'274	19'961'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024		613'524	7'627'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2024		1'573'251	12'388'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		89'245'806	15'150'366'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		75'784'129	623'276'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		3'037'315	36'679'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		1'777'991	2'735'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.01.2024		2'453'767	99'462'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		182'667'947	192'968'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		22'201'194	34'728'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		2'610'011	52'611'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024		1'564'963	7'217'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.01.2024		1'267'869	32'656'000		CHF/CZK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		366'201'976	422'723'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2024		1'545'557	2'888'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		33'372'354	30'421'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		554'600	4'543'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		272'584	425'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		1'479'320	1'557'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		289'145	263'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		244'774	4'914'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		889'259	150'465'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		2'930'869	3'367'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		2'610'000	1'680'161		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		263'000	171'429		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		24'403'000	21'255'745		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2024		3'936'000	328'203		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		31'789'000	3'879'625		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		44'000	9'555		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		10'868'000	10'252'708		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2024		85'000	10'759		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		1'156'000	666'833		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		5'553'000	276'498		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2024		53'000	4'254		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		820'430'000	4'882'075		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.01.2024		208'000	8'019		CZK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		1'926'000	2'116'115		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		259'000	31'526		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		6'967	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		159'029	169'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		12'000	13'166	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		236'956	1'947'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		145'817	227'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		459'838	528'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		8'000	4'589	AUD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		234'940	2'812'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		326'996	55'019'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		6'379'000	37'914	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		155'265	165'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		154'693	141'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		817'192	6'695'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		921'271	153'206'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		2'123'638	2'251'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		4'037'268	4'603'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		369'941	336'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		357'028	552'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		14'403	25'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		4'434	736'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		4'017	48'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		154'944	241'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		8'491	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		10'490	12'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		239'744	412'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		64'886	75'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		3'883	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		32'134	34'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		5'494	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		328'974	2'707'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024		241'344	2'920'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		16'748	2'736'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		22'071	38'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		41'830	65'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		62'330	57'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		6'001'000	723'961	CNY/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		173'852	29'053'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		346'315	367'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		892'600	1'040'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		38'552	6'427'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		1'885'653	2'193'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		314'375	333'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		11'982	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		429'696	3'566'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		10'329	16'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		2'892'234	3'073'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		1'426'939	236'587'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		5'773'626	6'745'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		486'401	449'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		118'580	1'400'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		129'376	2'580'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		402'680	626'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		1'220'436	10'177'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		317'843	547'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		74'000	46'931	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		43'000	24'671	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		169'400	1'441'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		213'868	36'026'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		244'255	263'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		908'000	759'363	USD/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		157'529	248'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		159'105	149'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2024		10'494'000	869'496	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		7'173'000	1'535'072	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		19'776'000	11'356'566	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		616'303'000	72'840'852	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.01.2024		32'448'000	1'221'894	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		54'552'000	2'710'460	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.01.2024		2'888'000	1'538'770	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		415'983'000	350'058'846	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2024		37'003'000	3'089'639	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		34'202'000	21'828'229	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		190'321'000	176'920'498	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		2'720'000	1'735'360	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2024		12'303'000	1'534'283	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 05.01.2024		99'462'000	2'452'435	THB/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		29'894'000	32'070'044	GBP/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.01.2024		9'273'855	13'796'529'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.01.2024		13'796'529'000	8'987'639	KRW/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024		866'884	3'724'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024		26'000	6'088	ILS/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024		142'108	602'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024		4'300'000	1'004'824	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		4'452'000	1'049'612	ILS/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		879'124	10'638'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		1'733'143	8'129'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		11'724'726	20'466'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		75'640'112	641'132'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.02.2024		1'265'098	33'749'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		1'594'341	3'002'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		371'935'792	443'439'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		3'156'252	37'882'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		23'102'285	36'303'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		186'825'310	201'387'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		1'784'165	2'802'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		91'484'925	15'300'299'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		1'589'871	12'772'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.02.2024		2'503'720	101'740'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		1'018'874	4'373'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		34'444'356	32'207'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		121'522	975'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		62'000	32'744	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		276'112	435'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.02.2024		648'000	24'339	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		777'000	64'556	SEK/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		236'195	415'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		883'539	7'468'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		55'000	35'104	SGD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		956'268	1'029'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		163'000	34'804	PLN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		3'316'371	3'914'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		216'000	17'773	NOK/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		275'502	256'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.02.2024		86'000	19'954	ILS/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		837'730	142'380'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		890'838	7'526'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		6'726	54'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		10'252	18'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		18'398	29'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		213'061	36'196'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		798'708	860'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		25'863	24'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		1'131'355	1'339'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		182'847	169'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		11'838	100'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		28'901	31'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		409'351	482'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		186'489	31'853'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		2'843	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		459'074	538'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		19'629	21'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		5'719	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		181'571	1'525'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		8'391	1'431'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		3'254	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		90'114	159'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		87'030	136'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.02.2024		87'085	2'308'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		24'836	4'240'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		21'312	179'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		87'060	165'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		86'604	1'055'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		369'078	430'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		97'772	90'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		182'153	286'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		87'293	1'059'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		227'009	243'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		7'750'104	8'904'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		4'029'709	4'272'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		2'166'133	17'845'000	CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		4'555	36'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		4'229	8'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		2'338'799	398'311'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		31'436	55'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		545'759	495'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		8'291	100'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		4'544	7'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		4'296	20'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		421'004	652'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		67'083	104'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		47'000	26'780	AUD/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		38'420	165'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		61'400	286'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CZK/CHF Verfall 05.02.2024		51'652	1'364'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		2'731'000	225'436	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		211'814'000	1'244'731	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		7'362'000	888'093	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		178'000	195'810	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		2'384'000	2'055'990	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		98'000	51'787	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		131'000	83'781	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		1'348'000	111'691	SEK/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		62'454	495'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		959'000	901'987	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		85'000	79'674	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		192'000	23'059	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		13'000	14'267	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		15'000	9'624	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		189'000	163'050	USD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		467'164	80'116'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		8'000	4'549	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		4'057'349	4'338'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		2'111'793	361'583'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		8'449'977	9'792'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		390'211	687'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		1'965'524	16'375'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		516'045	803'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		790'324	723'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		38'371'000	24'631'688	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		36'916'000	3'064'213	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		16'144'595'000	94'756'664	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		14'332'000	1'791'371	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		466'265'000	399'838'557	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		8'272'000	1'780'804	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 05.02.2024		101'740'000	2'459'971	THB/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		684'596'000	81'857'144	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		3'015'000	1'591'498	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		2'994'000	1'921'543	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		21'750'000	12'330'597	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CZK Verfall 05.02.2024		36'773'000	1'375'744	CZK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		211'137'000	196'688'895	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		33'776'000	36'887'648	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		8'746'000	717'268	NOK/CHF		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.02.2024		9'134'614	14'061'742'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 05.02.2024		303'729	467'695'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 05.02.2024		14'529'437'000	9'408'557	KRW/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		2'762'588	56'082'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		916'000	45'333	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		86'180	1'730'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		7'455	149'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		1'318'000	66'129	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		55'727'000	2'780'253	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		4'607'000	1'135'849	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		24'507'245	38'283'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.03.2024		3'161'468	38'164'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		2'845'079	57'471'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		95'529'468	16'253'474'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.03.2024		1'840'564	14'750'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		403'784'800	472'369'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.03.2024		1'843'714	8'594'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 05.03.2024		2'626'042	108'856'000	CHF/THB		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		83'528'568	699'663'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.03.2024		1'633'378	3'104'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.03.2024		1'972'986	3'080'000	CHF/SGD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AUD/CHF	Verfall 05.03.2024		12'420'696	21'958'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 05.03.2024		1'420'078	38'105'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.03.2024		36'187'347	33'233'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		200'489'890	215'632'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		1'076'280	4'576'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.03.2024		737'926	9'020'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.03.2024		95'102	169'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		7'279	31'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.03.2024		618'869	568'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		2'927'473	3'144'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.03.2024		3'212	5'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.03.2024		3'285	40'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.03.2024		459'249	717'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.03.2024		149'341	1'248'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.03.2024		8'409	39'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
CZK/CHF	Verfall 05.03.2024		8'683	232'000	CHF/CZK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 05.03.2024		4'730	9'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.03.2024		18'777	376'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.03.2024		10'747	86'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.03.2024		186'222	2'260'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		637'603	108'084'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		4'823'324	5'616'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.03.2024		151'096	267'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		220'358	236'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.03.2024		139'000	121'303	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.03.2024		9'000	9'902	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.03.2024		11'000	7'132	CAD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		224'649	239'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		156'444	26'697'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.03.2024		8'000	4'532	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.03.2024		203'000	24'597	CNY/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		276'101	293'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		201'981	231'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		182'945	31'171'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		191'473	202'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		295'511	336'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		189'621	32'321'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		210'056	239'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.03.2024		284'596	2'330'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		295'061	310'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		4'650	791'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		880'745	1'001'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		444'193	467'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		265'750	45'310'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.03.2024		188'673	289'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.03.2024		94'042	163'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		25'555	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.03.2024		189'119	170'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		5'106	871'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 05.03.2024		370'899	3'042'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		374'759	393'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.03.2024		185'062	31'652'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		1'000'086	1'138'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 05.03.2024		3'085'000	2'020'311	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 05.03.2024		57'847'000	2'983'702	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.03.2024		22'549'000	12'928'650	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 05.03.2024		9'060'000	752'741	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.03.2024		220'916'000	210'508'205	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CZK	Verfall 05.03.2024		38'337'000	1'443'541	CZK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.03.2024		706'080'000	86'297'098	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.03.2024		16'530'371'000	97'263'215	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 05.03.2024		14'836'000	1'896'553	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.03.2024		33'962'000	37'826'876	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 05.03.2024		8'633'000	1'906'097	PLN/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 05.03.2024		108'856'000	2'672'524	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 05.03.2024		3'113'000	1'669'956	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 05.03.2024		40'424'000	3'440'305	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.03.2024		39'278'000	25'498'767	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.03.2024		480'820'000	423'361'048	USD/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 06.03.2024		9'614'740	14'875'724'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 06.03.2024		14'875'724'000	9'801'246	KRW/CHF		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.04.2024		1'986'248	3'039'000	CHF/SGD		0.00	0.00	b)
MXN/CHF	Verfall 04.04.2024		2'963'651	57'926'000	CHF/MXN		0.00	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 04.04.2024		12'544'552	21'930'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	ILS/CHF Verfall 04.04.2024		1'130'103	4'595'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		741'234	8'944'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		202'024'360	212'445'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	CZK/CHF Verfall 04.04.2024		1'439'092	38'358'000		CHF/CZK	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		95'495'434	16'206'323'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		1'876'436	14'704'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		36'004'428	32'425'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 04.04.2024		1'891'905	8'600'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	THB/CHF Verfall 04.04.2024		2'695'178	110'054'000		CHF/THB	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.04.2024		1'655'465	3'096'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 04.04.2024		3'402'970	40'067'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		24'505'699	37'855'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		405'438'362	461'968'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	KRW/CHF Verfall 04.04.2024		10'883'883	16'552'090'000		CHF/KRW	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 04.04.2024		84'575'762	693'261'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	36'444'736.16	3.73
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	540'442'032.75	55.27
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	395'702'292.70	40.47
Derivative Finanzinstrumente	4'776.46	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5'215'772.73	0.53
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	977'809'610.80	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-20'956'793.45	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	956'852'817.35	

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);	936'144'325.45	95.74
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	4'776.46	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57337013
CAD	1 = CHF	0.64920559
CNY	1 = CHF	0.12220950
CZK	100 = CHF	3.76538400
DKK	100 = CHF	12.78327000
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
ILS	1 = CHF	0.24654217
JPY	100 = CHF	0.58832800
KRW	1 = CHF	0.00066127
MXN	1 = CHF	0.05159523
NOK	100 = CHF	8.30766300
NZD	1 = CHF	0.53647509
PLN	1 = CHF	0.22080544
SEK	100 = CHF	8.50982600
SGD	1 = CHF	0.65487877
THB	100 = CHF	2.45517900
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	914'435'155.07	95.567

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
NT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.255	0.00 - 0.05	-	0.014
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.255	0.00 - 0.05	-	0.014

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: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
NT CHF	-	-	-	-	3.000
NTH1 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

Bloomberg Global Aggregate Bond ex CHF Index TR

9 TER

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

10 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	Nein	CHF	2.052	0.718	1.334
NTH1 CHF	Nein	CHF	2.143	0.750	1.393

11 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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

12 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

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

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund
(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

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

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

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

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

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

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

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

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

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

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

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

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

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

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

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

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

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

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

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

2.2 Umtauschverhältnisse

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

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

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

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

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

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

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

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

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

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

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

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

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

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

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

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

Zudem wird bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I), Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung).

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

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

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

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

2 Gating-Verfahren

2.1 Einführung Gating-Verfahren bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I), Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 23. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

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

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

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich