

SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE CHF

Halbjahresbericht per 30.04.2024

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

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	32517290	CHF
BA CHF	123887465	CHF
CT CHF	37873450	CHF
DT CHF	18382812	CHF
GT CHF	32517291	CHF
MT CHF	52492050	CHF
NT CHF	2738294	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	22
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	22
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
7	Pauschale Verwaltungskommission	23
8	Benchmark	23
9	TER	23
10	Fussnoten	24
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	25

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	01.11.2023	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020
	bis	30.04.2024	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'229'319'080.52	3'496'577'565.64	3'159'582'238.76	2'869'261'027.83
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'566'353.82	1'278'663.18	813'291.94	1'100'763.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'856.524	14'177.519	9'273.691	11'193.233
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.9227	90.1895	87.6988	98.3419
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		92.6811	89.9460	87.9795	98.2632
Ausschüttung je Anteil		-	0.15	-	0.20
Total Expense Ratio (TER)		0.75 %	0.75 %	0.75 %	0.75 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'012'850.36	27'089'269.35		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		187'411.306	261'280.325		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		106.7857	103.6789		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		106.5081	103.3990		
Ausschüttung je Anteil		-	0.35		
Total Expense Ratio (TER)		0.48 %	0.48 %		
Klasse CT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'299'471.29	48'800'456.65	35'825'097.13	39'741'544.92
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		547'041.608	526'779.807	398'689.491	396'167.653
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.6042	92.6392	89.8571	100.3150
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		95.3556	92.3891	90.1447	100.2347
Thesaurierung je Anteil		-	0.39	0.13	0.18
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		14'186'623.32	12'084'284.27	5'553'157.32	1'736'100.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'596.297	11'954.045	5'666.954	1'587.999
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'043.4182	1'010.8950	979.9193	1'093.2632
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'040.7053	1'008.1656	983.0550	1'092.3886
Thesaurierung je Anteil		-	5.33	2.47	3.11
Total Expense Ratio (TER)		0.35 %	0.35 %	0.35 %	0.35 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		908'620'029.36	928'900'915.37	975'640'158.97	980'708'587.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'419'493.622	9'940'682.442	10'775'657.227	9'713'030.731
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.4617	93.4444	90.5411	100.9683
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		96.2109	93.1921	90.8309	100.8876
Thesaurierung je Anteil		-	0.55	0.29	0.35
Total Expense Ratio (TER)		0.28 %	0.28 %	0.28 %	0.28 %

Klasse MT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'425'924.77	2'250'108.09	2'176'351.01	2'422'627.49
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	26'098.455	25'000.000	25'000.000	25'000.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	92.9528	90.0043	87.0540	96.9051
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	92.7111	89.7613	87.3326	96.8276
Thesaurierung je Anteil	-	0.78	0.54	0.61
Total Expense Ratio (TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'230'207'827.60	2'476'173'868.73	2'139'574'182.39	1'843'551'403.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	2'320'735.651	1'837'280.638	1'641'330.839	1'270'475.073
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	1'391.8896	1'347.7385	1'303.5606	1'451.0725
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	1'388.2707	1'344.0996	1'307.7320	1'449.9116
Thesaurierung je Anteil	-	11.74	8.13	9.27
Total Expense Ratio (TER)	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse AA CHF	3.21 %	6.87 %	-12.17 %	-2.40 %
Klasse BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	3.35 %	7.16 %	-0.65 %	-
Klasse CT CHF	3.36 %	7.19 %	-11.91 %	-2.11 %
Klasse DT CHF	3.40 %	7.26 %	-11.54 %	-2.01 %
Klasse GT CHF	3.44 %	7.33 %	-11.47 %	-1.94 %
Klasse MT CHF	3.59 %	7.68 %	-11.51 %	-1.67 %
Klasse NT CHF	3.58 %	7.63 %	-11.23 %	-1.67 %
Benchmark	3.32 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	-	0.44 %	0.62 %	0.25 %

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 AA CHF	-0.11 %
Klasse BA CHF (Lancierung 27.12.2022)	0.03 %
Klasse CT CHF	0.04 %
Klasse DT CHF	0.08 %
Klasse GT CHF	0.12 %
Klasse MT CHF	0.27 %
Klasse NT CHF	0.26 %

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.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.04.2024	31.10.2023
Bankguthaben auf Sicht	0.34	58'286'821.32
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'228'712'357.70	3'418'399'533.54
Derivative Finanzinstrumente	0.00	-1'410'848.75
Sonstige Vermögenswerte	31'319'073.12	21'564'288.01
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'260'031'431.16	3'496'839'794.12
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-30'446'127.71	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-266'222.93	-262'228.48
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'229'319'080.52	3'496'577'565.64

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'177.519	9'273.691
Ausgegebene Anteile		3'118.596	6'128.484
Zurückgenommene Anteile		-439.591	-1'224.656
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		16'856.524	14'177.519
			<i>Lancierung</i>
Klasse BA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		261'280.325	-
Ausgegebene Anteile		18'178.265	291'853.452
Zurückgenommene Anteile		-92'047.284	-30'573.127
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		187'411.306	261'280.325
Klasse CT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		526'779.807	398'689.491
Ausgegebene Anteile		82'297.867	212'810.936
Zurückgenommene Anteile		-62'036.066	-84'720.620
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		547'041.608	526'779.807
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'954.045	5'666.954
Ausgegebene Anteile		2'018.952	7'197.730
Zurückgenommene Anteile		-376.700	-910.639
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'596.297	11'954.045
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'940'682.442	10'775'657.227
Ausgegebene Anteile		1'222'906.081	1'816'847.556
Zurückgenommene Anteile		-1'744'094.901	-2'651'822.341
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'419'493.622	9'940'682.442
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		25'000.000	25'000.000
Ausgegebene Anteile		1'098.455	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'098.455	25'000.000
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'837'280.638	1'641'330.839
Ausgegebene Anteile		201'988.777	175'522.378
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		367'323.248	139'468.800
Zurückgenommene Anteile		-85'857.012	-88'103.312
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-30'938.067
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'320'735.651	1'837'280.638

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	19.03.2024	224'313'871.25	162'268.663
Klasse NT CHF	19.03.2024	106'434'853.40	76'994.977
Klasse NT CHF	19.03.2024	172'361'088.53	124'686.018
Klasse NT CHF	20.03.2024	4'668'840.75	3'373.590

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'496'577'565.64	3'159'582'238.76
Ausbezahlte Ausschüttung		-66'112.20	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-9'775'512.76	-6'312'397.60
Saldo aus dem Anteilverkehr		612'585'832.12	227'982'335.44
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		129'997'307.72	115'325'389.04
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'229'319'080.52	3'496'577'565.64

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2023 30.04.2024	01.11.2022 31.10.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		56'066.57	51'877.82
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		19'919'667.16	30'482'481.24
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'999'442.73	1'219'827.87
Total Ertrag		22'975'176.46	31'754'186.93
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-15.15
Reglementarische Vergütungen		-1'468'240.27	-2'967'509.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-481'510.72	-1'267'156.53
Total Aufwand		-1'949'750.99	-4'234'681.58
Nettoertrag / Verlust		21'025'425.47	27'519'505.35
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'926'957.16	-81'149'908.08
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		1'299'901.14	1'480'179.48
Realisierter Erfolg		16'398'369.45	-52'150'223.25
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		113'598'938.27	167'475'612.29
Gesamterfolg		129'997'307.72	115'325'389.04

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							4'228'712'357.70	99.26	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							4'228'712'357.70	99.26	
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	95.35%	1'907'000.00	0.04	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	96.10%	6'727'000.00	0.16	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	5'400	2'000	0	7'400 CHF	98.70%	7'303'800.00	0.17	a)
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	0	3'600	0	3'600 CHF	100.55%	3'619'800.00	0.08	a)
AE							19'557'600.00	0.46	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'000	0	0	1'000 CHF	122.00%	1'220'000.00	0.03	a)
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	7'500	0	0	7'500 CHF	99.19%	7'439'250.00	0.17	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	3'000	8'000	0	11'000 CHF	90.45%	9'949'500.00	0.23	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	89.25%	7'140'000.00	0.17	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.80%	3'054'000.00	0.07	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	102.60%	2'462'400.00	0.06	a)
AT							31'265'150.00	0.73	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	97.60%	2'928'000.00	0.07	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'000	1'000	0	3'000 CHF	98.25%	2'947'500.00	0.07	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	8'400	1'500	0	9'900 CHF	99.05%	9'805'950.00	0.23	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.88%	1'997'600.00	0.05	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	8'530	0	0	8'530 CHF	96.90%	8'265'570.00	0.19	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'000	4'000	0	6'000 CHF	96.10%	5'766'000.00	0.14	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	2'000	0	4'000 CHF	92.50%	3'700'000.00	0.09	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	1'000	2'000	1'300	1'700 CHF	93.40%	1'587'800.00	0.04	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	93.95%	1'879'000.00	0.04	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	95.20%	4'760'000.00	0.11	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	5'100	0	0	5'100 CHF	90.40%	4'610'400.00	0.11	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	98.25%	1'866'750.00	0.04	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	8'150	0	0	8'150 CHF	99.31%	8'093'765.00	0.19	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	2'000	0	0	2'000 CHF	101.95%	2'039'000.00	0.05	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	4'000	0	0	4'000 CHF	103.50%	4'140'000.00	0.10	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	102.95%	2'059'000.00	0.05	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	12'000	0	0	12'000 CHF	103.45%	12'414'000.00	0.29	a)
AU							78'860'335.00	1.85	
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	5'000	1'150	0	6'150 CHF	99.33%	6'108'795.00	0.14	a)
BM							6'108'795.00	0.14	
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	97.90%	4'895'000.00	0.11	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	3'100	0	0	3'100 CHF	91.40%	2'833'400.00	0.07	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	94.65%	2'839'500.00	0.07	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	11'250	0	0	11'250 CHF	98.15%	11'041'875.00	0.26	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	94.70%	1'420'500.00	0.03	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	96.40%	2'892'000.00	0.07	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	90.70%	1'814'000.00	0.04	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	93.65%	3'746'000.00	0.09	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	14'000	5'000	0	19'000 CHF	96.50%	18'335'000.00	0.43	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	595	0	0	595 CHF	96.80%	575'960.00	0.01	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	5'000	0	2'000	3'000 CHF	98.90%	2'967'000.00	0.07	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	5'000	0	0	5'000 CHF	96.70%	4'835'000.00	0.11	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.70%	1'994'000.00	0.05	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.85%	5'092'500.00	0.12	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'000	0	0	1'000 CHF	101.20%	1'012'000.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.10%	5'105'000.00	0.12	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	2'500	1'000	0	3'500 CHF	102.50%	3'587'500.00	0.08	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	5'000	0	0	5'000 CHF	102.45%	5'122'500.00	0.12	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	3'500	0	0	3'500 CHF	101.25%	3'543'750.00	0.08	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	3'000	0	0	3'000 CHF	105.35%	3'160'500.00	0.07	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	5'000	0	1'750	3'250 CHF	101.25%	3'290'625.00	0.08	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	5'000	1'750	0	6'750 CHF	102.75%	6'935'625.00	0.16	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	4'000	500	0	4'500 CHF	102.65%	4'619'250.00	0.11	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	100.40%	3'012'000.00	0.07	a)
CH1331113584	1.3550 % CCDJ 1.355 04/18/27 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	99.91%	3'996'240.00	0.09	a)
CH1331113592	1.4200 % CCDJ 1.42 04/18/30 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	99.84%	6'988'450.00	0.16	a)
CH1344316737	1.5225 % MP 1.5225 05/16/34	0	4'000	0	4'000 CHF	100.27%	4'010'760.00	0.09	a)
CA							119'665'935.00	2.81	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	900	0	0	900 CHF	174.70%	1'572'300.00	0.04	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	0	1'710	0	1'710 CHF	113.75%	1'945'125.00	0.05	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	0	1'500	0	1'500 CHF	102.05%	1'530'750.00	0.04	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	15'800	0	0	15'800 CHF	100.07%	15'811'060.00	0.37	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	5'500	9'000	0	14'500 CHF	101.24%	14'679'800.00	0.34	a)
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	3'000	0	0	3'000 CHF	107.20%	3'216'000.00	0.08	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	6'000	0	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	1'500	0	0	1'500 CHF	106.67%	1'600'050.00	0.04	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	39'300	0	0	39'300 CHF	103.51%	40'679'430.00	0.95	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	12'800	0	0	12'800 CHF	101.20%	12'953'600.00	0.30	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	8'250	0	3'000	5'250 CHF	103.53%	5'435'325.00	0.13	a)
CH0120381592	2.0000 % KBLUZE 2 12/06/33	2'400	0	0	2'400 CHF	104.50%	2'508'000.00	0.06	a)
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	2'000	0	0	2'000 CHF	103.21%	2'064'200.00	0.05	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	3'000	1'500	0	4'500 CHF	108.07%	4'863'150.00	0.11	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	18'691	0	0	18'691 CHF	110.22%	20'601'220.20	0.48	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	5'000	0	0	5'000 CHF	112.98%	5'649'000.00	0.13	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	5'000	0	0	5'000 CHF	108.10%	5'405'000.00	0.13	a)
CH0132163434	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 06/30/31	0	1'500	0	1'500 CHF	106.40%	1'596'000.00	0.04	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	2'800	0	0	2'800 CHF	100.01%	2'800'280.00	0.07	a)
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	3'000	0	0	3'000 CHF	100.40%	3'012'000.00	0.07	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	18'000	0	0	18'000 CHF	101.80%	18'324'000.00	0.43	a)
CH0180428531	2.8750 % KWLILJ 2 7/8 03/27/42	1'500	0	0	1'500 CHF	107.95%	1'619'250.00	0.04	a)
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	9'750	0	0	9'750 CHF	100.05%	9'754'875.00	0.23	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	2'000	250	0	2'250 CHF	100.65%	2'264'625.00	0.05	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	8'400	0	3'700	4'700 CHF	101.60%	4'775'200.00	0.11	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	0	2'000	0	2'000 CHF	100.75%	2'015'000.00	0.05	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	0	1'500	500	1'000 CHF	100.81%	1'008'100.00	0.02	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	4'200	0	0	4'200 CHF	99.15%	4'164'300.00	0.10	a)
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	4'790	0	4'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMNVD 1 3/4 07/10/24	8'400	0	0	8'400 CHF	100.03%	8'402'520.00	0.20	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	0	5'000	0	5'000 CHF	100.15%	5'007'500.00	0.12	a)
CH0194958960	3.0000 % KWLILJ 3 09/27/52	1'400	0	0	1'400 CHF	109.25%	1'529'500.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	7'300	0	7'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	3'000	0	0	3'000 CHF	100.45%	3'013'500.00	0.07	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	1'000	0	1'000 CHF	102.85%	1'028'500.00	0.02	a)
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	0	1'000	0	1'000 CHF	100.24%	1'002'400.00	0.02	a)
CH0204811100	1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25	2'250	2'180	0	4'430 CHF	100.13%	4'435'759.00	0.10	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	0	500	0	500 CHF	101.55%	507'750.00	0.01	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	4'500	0	4'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	15'550	0	0	15'550 CHF	101.54%	15'789'470.00	0.37	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	3'000	0	0	3'000 CHF	104.10%	3'123'000.00	0.07	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	0	500	0	500 CHF	108.30%	541'500.00	0.01	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	5'000	0	0	5'000 CHF	150.23%	7'511'500.00	0.18	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	7'500	0	7'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	7'500	0	0	7'500 CHF	96.15%	7'211'250.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	1'000	1'000	0	2'000 CHF	107.05%	2'141'000.00	0.05	a)
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	4'500	0	0	4'500 CHF	100.10%	4'504'500.00	0.11	a)
CH0228531437	2.3750 % KWLILJ 2 3/8 12/10/26	3'550	1'500	0	5'050 CHF	102.00%	5'151'000.00	0.12	a)
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	14'000	0	14'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237552101	1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24	13'550	0	13'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240109774	1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	0	2'200	0	2'200 CHF	99.85%	2'196'700.00	0.05	a)
CH0245691537	1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24	0	200	0	200 CHF	100.01%	200'020.00	0.00	a)
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	15'000	1'000	1'000	15'000 CHF	100.78%	15'117'000.00	0.35	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	2'700	0	0	2'700 CHF	101.80%	2'748'600.00	0.06	a)
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	1'500	5'000	0	6'500 CHF	100.21%	6'513'650.00	0.15	a)
CH0249483667	1.3750 % GENEVA 1 3/8 09/29/34	3'000	0	0	3'000 CHF	100.65%	3'019'500.00	0.07	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	6'200	0	0	6'200 CHF	99.81%	6'188'220.00	0.15	a)
CH0252703050	1.2500 % KWLILJ 1 1/4 09/11/24	700	0	0	700 CHF	99.84%	698'880.00	0.02	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	13'500	0	0	13'500 CHF	101.40%	13'689'000.00	0.32	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	15'000	0	0	15'000 CHF	99.70%	14'955'000.00	0.35	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	10'665	0	7'500	3'165 CHF	99.71%	3'155'821.50	0.07	a)
CH0257042173	2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24	7'200	0	0	7'200 CHF	100.25%	7'218'000.00	0.17	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	5'400	1'000	0	6'400 CHF	98.45%	6'300'800.00	0.15	a)
CH0262881458	1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25	11'000	0	0	11'000 CHF	99.56%	10'951'600.00	0.26	a)
CH0262883199	1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25	0	1'800	0	1'800 CHF	99.80%	1'796'400.00	0.04	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	0	2'500	0	2'500 CHF	94.72%	2'368'000.00	0.06	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	2'800	7'000	0	9'800 CHF	95.99%	9'407'020.00	0.22	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	0	5'000	0	5'000 CHF	95.90%	4'795'000.00	0.11	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	0	200	0	200 CHF	97.00%	194'000.00	0.00	a)
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	3'000	2'000	3'000	2'000 CHF	96.40%	1'928'000.00	0.05	a)
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	0	2'000	0	2'000 CHF	95.20%	1'904'000.00	0.04	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	6'500	1'000	0	7'500 CHF	96.79%	7'259'250.00	0.17	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	0	5'000	0	5'000 CHF	97.30%	4'865'000.00	0.11	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	0	9'000	0	9'000 CHF	96.75%	8'707'500.00	0.20	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	7'740	500	0	8'240 CHF	93.30%	7'687'920.00	0.18	a)
CH0279135328	0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30	0	6'000	6'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	7'100	0	0	7'100 CHF	98.80%	7'014'800.00	0.16	a)
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	4'500	1'000	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282019006	1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25	1'500	0	0	1'500 CHF	99.56%	1'493'400.00	0.04	a)
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	0	550	0	550 CHF	93.07%	511'885.00	0.01	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	4'000	0	0	4'000 CHF	93.15%	3'726'000.00	0.09	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	5'000	0	0	5'000 CHF	97.86%	4'893'000.00	0.11	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	800	8'000	0	8'800 CHF	99.04%	8'715'520.00	0.20	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	0	2'000	0	2'000 CHF	99.83%	1'996'600.00	0.05	a)
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	0	3'000	1'500	1'500 CHF	94.95%	1'424'250.00	0.03	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	20'800	0	0	20'800 CHF	95.13%	19'787'040.00	0.46	a)
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	0	1'000	0	1'000 CHF	96.25%	962'500.00	0.02	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	12'000	0	0	12'000 CHF	95.84%	11'500'800.00	0.27	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	7'500	0	7'500 CHF	100.65%	7'548'750.00	0.18	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	12'000	0	0	12'000 CHF	91.11%	10'933'200.00	0.26	a)
CH0310646523	0.5000 % KBFRIJ 0 1/2 02/23/28	0	1'000	0	1'000 CHF	96.30%	963'000.00	0.02	a)
CH0312512681	0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25	0	6'100	0	6'100 CHF	99.15%	6'048'150.00	0.14	a)
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	0	1'000	0	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.02	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	1'460	1'000	0	2'460 CHF	97.90%	2'408'340.00	0.06	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	0	4'500	0	4'500 CHF	94.98%	4'274'100.00	0.10	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	0	1'000	0	1'000 CHF	92.61%	926'100.00	0.02	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	4'000	0	0	4'000 CHF	89.90%	3'596'000.00	0.08	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	3'000	0	0	3'000 CHF	95.79%	2'873'700.00	0.07	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	0	5'500	0	5'500 CHF	85.10%	4'680'500.00	0.11	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	4'000	0	0	4'000 CHF	83.20%	3'328'000.00	0.08	a)
CH0330143147	1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24	15'000	0	0	15'000 CHF	100.00%	15'000'000.00	0.35	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	1'000	0	0	1'000 CHF	95.70%	957'000.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	7'500	0	0	7'500 CHF	84.50%	6'337'500.00	0.15	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	5'000	0	0	5'000 CHF	98.24%	4'912'000.00	0.12	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	8'500	0	0	8'500 CHF	83.02%	7'056'700.00	0.17	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	12'250	0	0	12'250 CHF	79.96%	9'795'100.00	0.23	a)
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	3'455	0	3'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	18'000	0	8'000	10'000 CHF	96.50%	9'650'000.00	0.23	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	2'500	0	0	2'500 CHF	96.87%	2'421'750.00	0.06	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	18'500	0	3'000	15'500 CHF	89.93%	13'939'150.00	0.33	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	3'000	0	0	3'000 CHF	81.77%	2'453'100.00	0.06	a)
CH0340953428	0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28	3'700	0	0	3'700 CHF	95.90%	3'548'300.00	0.08	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	2'000	0	0	2'000 CHF	81.75%	1'635'000.00	0.04	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	5'000	0	0	5'000 CHF	91.30%	4'565'000.00	0.11	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	0	4'655	4'655	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	10'000	0	0	10'000 CHF	95.75%	9'575'000.00	0.22	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	20'300	0	0	20'300 CHF	96.06%	19'500'180.00	0.46	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'000	500	0	1'500 CHF	96.42%	1'446'300.00	0.03	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	3'400	200	0	3'600 CHF	98.20%	3'535'200.00	0.08	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	0	10'000	0	10'000 CHF	95.37%	9'537'000.00	0.22	a)
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	8'950	0	8'950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483160	2.0000 % KWLILI 2 12/11/23	9'500	0	9'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	9'000	0	0	9'000 CHF	90.35%	8'131'500.00	0.19	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	2'000	0	2'000 CHF	96.00%	1'920'000.00	0.05	a)
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.35%	983'500.00	0.02	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	10'000	2'000	2'000	10'000 CHF	96.83%	9'683'000.00	0.23	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	0	2'000	0	2'000 CHF	95.75%	1'915'000.00	0.04	a)
CH0361532895	0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24	3'300	0	0	3'300 CHF	99.85%	3'295'050.00	0.08	a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	1'000	0	0	1'000 CHF	93.45%	934'500.00	0.02	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	5'000	0	0	5'000 CHF	93.25%	4'662'500.00	0.11	a)
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	10'000	0	0	10'000 CHF	96.60%	9'660'000.00	0.23	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	5'180	0	0	5'180 CHF	90.65%	4'695'670.00	0.11	a)
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	2'000	0	0	2'000 CHF	96.15%	1'923'000.00	0.05	a)
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	2'000	0	500	1'500 CHF	96.10%	1'441'500.00	0.03	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	0	500	0	500 CHF	98.50%	492'500.00	0.01	a)
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	4'800	0	0	4'800 CHF	93.35%	4'480'800.00	0.11	a)
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'000	1'000	0	2'000 CHF	96.10%	1'922'000.00	0.05	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	15'000	0	3'500	11'500 CHF	96.77%	11'128'550.00	0.26	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	7'900	0	0	7'900 CHF	98.80%	7'805'200.00	0.18	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	18'000	0	1'000	17'000 CHF	96.34%	16'377'800.00	0.38	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	4'000	0	0	4'000 CHF	96.30%	3'852'000.00	0.09	a)
CH0373476784	0.5000 % KBSH 0 1/2 05/31/28	2'500	0	0	2'500 CHF	96.35%	2'408'750.00	0.06	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	5'000	0	4'000	1'000 CHF	96.40%	964'000.00	0.02	a)
CH0385997090	0.2500 % CMBNSW 0 1/4 05/23/24	9'950	0	0	9'950 CHF	99.92%	9'942'040.00	0.23	a)
CH0385997116	0.7000 % NEUNBG 0.7 11/23/37	1'000	0	0	1'000 CHF	90.90%	909'000.00	0.02	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	1'500	4'250	0	5'750 CHF	96.55%	5'551'625.00	0.13	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	11'800	0	4'250	7'550 CHF	94.60%	7'142'300.00	0.17	a)
CH0391648018	1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25	3'255	0	0	3'255 CHF	99.97%	3'254'023.50	0.08	a)
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	0	1'000	0	1'000 CHF	95.60%	956'000.00	0.02	a)
CH0394905704	0.1250 % KBBS 0 1/8 04/11/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	0	2'000	0	2'000 CHF	97.00%	1'940'000.00	0.05	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	2'200	0	0	2'200 CHF	99.40%	2'186'800.00	0.05	a)
CH0398633252	1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0	2'000	0	0	2'000 CHF	99.89%	1'997'800.00	0.05	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	0	1'000	0	1'000 CHF	97.45%	974'500.00	0.02	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	0	3'800	0	3'800 CHF	97.10%	3'689'800.00	0.09	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	3'500	3'000	0	6'500 CHF	95.20%	6'188'000.00	0.15	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	3'000	0	0	3'000 CHF	94.71%	2'841'300.00	0.07	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	1'900	0	1'900 CHF	98.90%	1'879'100.00	0.04	a)
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	0	1'000	0	1'000 CHF	96.69%	966'900.00	0.02	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	7'000	0	0	7'000 CHF	97.55%	6'828'500.00	0.16	a)
CH0398678901	0.3750 % BELLSW 0 3/8 02/01/24	6'100	0	6'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	0	1'000	0	1'000 CHF	97.75%	977'500.00	0.02	a)
CH0399611307	0.3500 % KBLUZE 0.35 02/05/27	0	1'000	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	5'880	0	0	5'880 CHF	96.40%	5'668'320.00	0.13	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	2'700	0	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	5'250	8'950	0	14'200 CHF	98.05%	13'923'100.00	0.33	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	4'500	0	4'500 CHF	98.91%	4'450'950.00	0.10	a)
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618353	0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28	0	1'000	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.02	a)
CH0419040768	2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25	5'000	2'000	0	7'000 CHF	100.17%	7'011'900.00	0.16	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	5'000	0	0	5'000 CHF	97.85%	4'892'500.00	0.11	a)
CH0419040800	0.4100 % KBLUZE 0.41 01/31/29	5'000	0	0	5'000 CHF	95.40%	4'770'000.00	0.11	a)
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	14'250	0	0	14'250 CHF	94.74%	13'500'450.00	0.32	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	23'700	0	0	23'700 CHF	95.10%	22'538'700.00	0.53	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	0	4'000	0	4'000 CHF	90.05%	3'602'000.00	0.08	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	1'000	4'000	0	5'000 CHF	98.95%	4'947'500.00	0.12	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	5'500	4'000	0	9'500 CHF	94.00%	8'930'000.00	0.21	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	8'840	6'000	5'000	9'840 CHF	91.45%	8'998'680.00	0.21	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	5'000	0	1'000	4'000 CHF	90.30%	3'612'000.00	0.08	a)
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	2'000	5'000	0	7'000 CHF	93.65%	6'555'500.00	0.15	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	0	2'500	0	2'500 CHF	96.30%	2'407'500.00	0.06	a)
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	6'000	0	0	6'000 CHF	84.75%	5'085'000.00	0.12	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	6'410	0	0	6'410 CHF	92.20%	5'910'020.00	0.14	a)
CH0419041378	0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29	1'200	0	0	1'200 CHF	95.75%	1'149'000.00	0.03	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	6'000	0	0	6'000 CHF	85.95%	5'157'000.00	0.12	a)
CH0419041428	0.0000 % KSWINT 0 09/30/31	3'000	0	0	3'000 CHF	86.45%	2'593'500.00	0.06	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	4'000	0	0	4'000 CHF	92.75%	3'710'000.00	0.09	a)
CH0419041576	0.1500 % KBLUZE 0.15 10/07/44	15'800	0	5'000	10'800 CHF	76.65%	8'278'200.00	0.19	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	3'800	0	0	3'800 CHF	78.15%	2'969'700.00	0.07	a)
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	15'000	0	0	15'000 CHF	91.85%	13'777'500.00	0.32	a)
CH0419041675	0.0000 % VALIAN 0 10/31/25	9'650	0	0	9'650 CHF	97.70%	9'428'050.00	0.22	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	16'500	0	0	16'500 CHF	96.21%	15'874'650.00	0.37	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24	600	0	0	600 CHF	99.81%	598'860.00	0.01	a)
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	4'000	0	2'000	2'000 CHF	96.14%	1'922'800.00	0.05	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	0	2'000	0	2'000 CHF	92.36%	1'847'200.00	0.04	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	0	2'000	0	2'000 CHF	99.65%	1'993'000.00	0.05	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	0	3'000	0	3'000 CHF	96.30%	2'889'000.00	0.07	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	6'000	1'500	0	7'500 CHF	96.99%	7'274'250.00	0.17	a)
CH0434678428	1.6000 % SUNSW 1.6 10/22/24	2'000	0	0	2'000 CHF	99.76%	1'995'200.00	0.05	a)
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	13'200	3'000	0	16'200 CHF	94.20%	15'260'400.00	0.36	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	15'000	0	0	15'000 CHF	92.70%	13'905'000.00	0.33	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	15'875	0	0	15'875 CHF	89.53%	14'212'887.50	0.33	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	31'000	0	0	31'000 CHF	110.65%	34'301'500.00	0.81	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	1'000	0	0	1'000 CHF	95.35%	953'500.00	0.02	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	7'250	0	0	7'250 CHF	93.95%	6'811'375.00	0.16	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	0	1'000	0	1'000 CHF	97.75%	977'500.00	0.02	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	0	7'800	0	7'800 CHF	90.08%	7'026'240.00	0.16	a)
CH0461238898	0.3000 % EGW 0.3 11/25/39 62	3'000	2'000	0	5'000 CHF	86.95%	4'347'500.00	0.10	a)
CH0461238906	0.0000 % SLHNXX 0 06/06/25 EMTN	13'250	0	0	13'250 CHF	98.41%	13'039'325.00	0.31	a)
CH0461238914	0.3500 % SLHNXX 0.35 03/06/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	94.90%	1'898'000.00	0.04	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	12'000	0	0	12'000 CHF	85.25%	10'230'000.00	0.24	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	0	4'000	0	4'000 CHF	90.60%	3'624'000.00	0.09	a)
CH0468581571	1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27	5'000	0	0	5'000 CHF	97.65%	4'882'500.00	0.11	a)
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	6'000	2'000	0	8'000 CHF	93.65%	7'492'000.00	0.18	a)
CH0471297983	0.8750 % HIAGSW 0 7/8 05/08/24	1'200	0	0	1'200 CHF	99.97%	1'199'640.00	0.03	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	6'500	0	0	6'500 CHF	94.15%	6'119'750.00	0.14	a)
CH0474977730	0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26	7'850	1'200	2'000	7'050 CHF	98.30%	6'930'150.00	0.16	a)
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	6'000	1'000	1'100	5'900 CHF	92.25%	5'442'750.00	0.13	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	4'400	0	1'000	3'400 CHF	92.08%	3'130'720.00	0.07	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	0	2'000	0	2'000 CHF	85.24%	1'704'800.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	92.15%	2'119'450.00	0.05	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	2'000	0	0	2'000 CHF	95.98%	1'919'600.00	0.05	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	7'800	0	0	7'800 CHF	89.10%	6'949'800.00	0.16	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	3'000	0	0	3'000 CHF	84.30%	2'529'000.00	0.06	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	13'310	0	0	13'310 CHF	70.75%	9'416'825.00	0.22	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	2'500	0	0	2'500 CHF	92.45%	2'311'250.00	0.05	a)
CH0487087295	0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27	2'575	1'570	0	4'145 CHF	96.00%	3'979'200.00	0.09	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	1'500	6'500	0	8'000 CHF	68.65%	5'492'000.00	0.13	a)
CH0496692986	0.0000 % BALHOL 0 09/25/29	4'000	3'000	4'000	3'000 CHF	92.05%	2'761'500.00	0.06	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	775	0	775	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	16'885	0	0	16'885 CHF	95.00%	16'040'750.00	0.38	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	9'000	2'000	0	11'000 CHF	91.25%	10'037'500.00	0.24	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	0	5'000	0	5'000 CHF	90.95%	4'547'500.00	0.11	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	2'400	0	0	2'400 CHF	79.90%	1'917'600.00	0.05	a)
CH0506071189	0.0000 % GLRNKB 0 09/06/28	5'000	0	0	5'000 CHF	94.05%	4'702'500.00	0.11	a)
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	7'000	2'000	1'000	8'000 CHF	92.15%	7'372'000.00	0.17	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	0	4'700	0	4'700 CHF	90.90%	4'272'300.00	0.10	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	5'000	2'700	0	7'700 CHF	85.55%	6'587'350.00	0.15	a)
CH0515152475	0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31	0	2'000	0	2'000 CHF	89.70%	1'794'000.00	0.04	a)
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	7'400	0	0	7'400 CHF	98.00%	7'252'000.00	0.17	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	8'500	0	600	7'900 CHF	89.85%	7'098'150.00	0.17	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	2'800	0	0	2'800 CHF	88.40%	2'475'200.00	0.06	a)
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	0	1'500	0	1'500 CHF	86.60%	1'299'000.00	0.03	a)
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	1'500	0	0	1'500 CHF	90.15%	1'352'250.00	0.03	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	675	0	675	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	8'500	0	0	8'500 CHF	91.50%	7'777'500.00	0.18	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	8'000	0	0	8'000 CHF	97.05%	7'764'000.00	0.18	a)
CH0522159000	1.6250 % KBLUZE 1 5/8 11/13/42	7'750	5'000	0	12'750 CHF	101.30%	12'915'750.00	0.30	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	0	1'500	0	1'500 CHF	102.65%	1'539'750.00	0.04	a)
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	0	4'700	0	4'700 CHF	89.00%	4'183'000.00	0.10	a)
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	8'250	0	0	8'250 CHF	95.09%	7'844'925.00	0.18	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	31'950	0	0	31'950 CHF	74.15%	23'690'925.00	0.56	a)
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	0	7'000	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892570	0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	1'000	0	0	1'000 CHF	98.50%	985'000.00	0.02	a)
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	9'820	0	9'820	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	2'800	0	0	2'800 CHF	90.50%	2'534'000.00	0.06	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	6'000	0	0	6'000 CHF	80.25%	4'815'000.00	0.11	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	2'300	0	0	2'300 CHF	92.67%	2'131'410.00	0.05	a)
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	2'400	0	0	2'400 CHF	87.21%	2'093'040.00	0.05	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	2'500	0	0	2'500 CHF	86.35%	2'158'750.00	0.05	a)
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	1'800	0	1'800 CHF	95.85%	1'725'300.00	0.04	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	1'000	1'000	0	2'000 CHF	84.90%	1'698'000.00	0.04	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	500	2'000	0	2'500 CHF	86.10%	2'152'500.00	0.05	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	5'000	0	3'500	1'500 CHF	95.23%	1'428'450.00	0.03	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	0.02	a)
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	5'000	0	0	5'000 CHF	93.75%	4'687'500.00	0.11	a)
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	1'500	0	0	1'500 CHF	89.80%	1'347'000.00	0.03	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	0	5'000	0	5'000 CHF	83.60%	4'180'000.00	0.10	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	3'140	0	0	3'140 CHF	98.58%	3'095'412.00	0.07	a)
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	2'500	0	2'500 CHF	97.10%	2'427'500.00	0.06	a)
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	4'500	7'600	0	12'100 CHF	94.80%	11'470'800.00	0.27	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	2'300	1'340	0	3'640 CHF	80.34%	2'924'376.00	0.07	a)
CH0551990689	0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25	3'565	1'200	0	4'765 CHF	98.51%	4'694'001.50	0.11	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	3'000	2'500	0	5'500 CHF	99.12%	5'451'600.00	0.13	a)
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	17'000	0	0	17'000 CHF	94.87%	16'127'900.00	0.38	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	5'200	0	0	5'200 CHF	80.47%	4'184'440.00	0.10	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	6'000	0	0	6'000 CHF	92.15%	5'529'000.00	0.13	a)
CH0565630610	0.2500 % KBLUZE 0 1/4 08/28/40	5'000	0	1'500	3'500 CHF	81.80%	2'863'000.00	0.07	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	7'000	900	0	7'900 CHF	90.25%	7'129'750.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	32'750	0	0	32'750 CHF	92.37%	30'251'175.00	0.71	a)
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	5'200	0	0	5'200 CHF	88.95%	4'209'400.00	0.10	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	10'300	0	0	10'300 CHF	88.60%	9'125'800.00	0.21	a)
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	7'000	0	0	7'000 CHF	94.50%	6'615'000.00	0.16	a)
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	24'000	0	0	24'000 CHF	92.90%	22'296'000.00	0.52	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	12'750	5'000	0	17'750 CHF	94.50%	16'773'750.00	0.39	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	500	5'000	5'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030979	0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25	1'800	0	0	1'800 CHF	98.77%	1'777'860.00	0.04	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	24'300	0	0	24'300 CHF	93.87%	22'810'410.00	0.54	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	20'000	0	0	20'000 CHF	84.45%	16'890'000.00	0.40	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	5'000	0	0	5'000 CHF	86.85%	4'342'500.00	0.10	a)
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	5'000	0	0	5'000 CHF	96.35%	4'817'500.00	0.11	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	6'000	0	0	6'000 CHF	77.68%	4'660'800.00	0.11	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	10'000	0	0	10'000 CHF	91.73%	9'173'000.00	0.22	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	20'000	3'500	0	23'500 CHF	95.07%	22'341'450.00	0.52	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	0	3'100	0	3'100 CHF	96.10%	2'979'100.00	0.07	a)
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	6'000	0	0	6'000 CHF	92.65%	5'559'000.00	0.13	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	9'500	0	0	9'500 CHF	87.10%	8'274'500.00	0.19	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	89.75%	3'590'000.00	0.08	a)
CH1111392994	0.3000 % ISHZ 0.3 06/29/26	0	3'750	0	3'750 CHF	96.40%	3'615'000.00	0.08	a)
CH1112246744	0.8750 % KBLUZE 0 7/8 05/14/31	6'600	5'000	0	11'600 CHF	91.60%	10'625'600.00	0.25	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33	4'000	0	0	4'000 CHF	88.30%	3'532'000.00	0.08	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	0	4'000	0	4'000 CHF	89.90%	3'596'000.00	0.08	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	5'000	1'100	900	5'200 CHF	90.45%	4'703'400.00	0.11	a)
CH1118223382	1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31	5'450	3'850	0	9'300 CHF	93.70%	8'714'100.00	0.20	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	0	3'200	0	3'200 CHF	90.20%	2'886'400.00	0.07	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	29'000	0	1'200	27'800 CHF	89.90%	24'992'200.00	0.59	a)
CH1118483697	0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24	1'650	0	0	1'650 CHF	98.94%	1'632'510.00	0.04	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	6'250	0	0	6'250 CHF	94.50%	5'906'250.00	0.14	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	0	6'200	0	6'200 CHF	81.75%	5'068'500.00	0.12	a)
CH1127263981	0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31	1'000	0	0	1'000 CHF	91.80%	918'000.00	0.02	a)
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	1'500	0	0	1'500 CHF	91.60%	1'374'000.00	0.03	a)
CH1130818839	0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30	2'250	3'750	0	6'000 CHF	91.25%	5'475'000.00	0.13	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	7'000	0	0	7'000 CHF	90.45%	6'331'500.00	0.15	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	2'600	0	0	2'600 CHF	83.90%	2'181'400.00	0.05	a)
CH1131931276	0.0000 % KSWINT 0 09/30/25	1'140	0	0	1'140 CHF	97.37%	1'110'018.00	0.03	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	10'000	0	0	10'000 CHF	91.00%	9'100'000.00	0.21	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	13'000	0	0	13'000 CHF	86.97%	11'306'100.00	0.27	a)
CH1137122755	0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25	1'650	0	0	1'650 CHF	97.84%	1'614'360.00	0.04	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	3'000	0	0	3'000 CHF	76.50%	2'295'000.00	0.05	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	8'000	0	0	8'000 CHF	87.85%	7'028'000.00	0.16	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	6'700	0	0	6'700 CHF	98.66%	6'610'220.00	0.16	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	5'000	0	5'000 CHF	96.10%	4'805'000.00	0.11	a)
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	4'300	0	0	4'300 CHF	76.05%	3'270'150.00	0.08	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	33'500	5'000	0	38'500 CHF	91.47%	35'215'950.00	0.83	a)
CH1145096165	0.4350 % UBS 0.435 11/09/28	15'600	0	5'600	10'000 CHF	94.60%	9'460'000.00	0.22	a)
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	13'000	0	1'000	12'000 CHF	91.43%	10'971'600.00	0.26	a)
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	9'000	0	0	9'000 CHF	91.25%	8'212'500.00	0.19	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	9'700	0	0	9'700 CHF	91.62%	8'887'140.00	0.21	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	5'000	5'000	0	10'000 CHF	85.20%	8'520'000.00	0.20	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	10'000	0	0	10'000 CHF	96.92%	9'692'000.00	0.23	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	9'500	0	0	9'500 CHF	91.43%	8'685'850.00	0.20	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	0	11'000	0	11'000 CHF	87.41%	9'615'100.00	0.23	a)
CH1160188335	0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25	0	570	0	570 CHF	99.00%	564'300.00	0.01	a)
CH1160680141	0.0000 % BKWSW 0 10/18/24	2'650	0	2'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	4'000	2'000	2'000 CHF	97.75%	1'955'000.00	0.05	a)
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	500	4'500	500	4'500 CHF	94.55%	4'254'750.00	0.10	a)
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	6'800	0	0	6'800 CHF	82.40%	5'603'200.00	0.13	a)
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	9'000	0	0	9'000 CHF	95.65%	8'608'500.00	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	2'500	0	0	2'500 CHF	96.36%	2'409'000.00	0.06	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	8'000	0	0	8'000 CHF	95.50%	7'640'000.00	0.18	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	7'500	2'000	0	9'500 CHF	94.35%	8'963'250.00	0.21	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	6'720	0	0	6'720 CHF	100.05%	6'723'360.00	0.16	a)
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	2'500	0	0	2'500 CHF	98.75%	2'468'750.00	0.06	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	20'000	0	0	20'000 CHF	99.19%	19'838'000.00	0.47	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	7'500	0	0	7'500 CHF	99.95%	7'496'250.00	0.18	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	500	5'000	0	5'500 CHF	100.32%	5'517'600.00	0.13	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	11'300	4'000	0	15'300 CHF	94.10%	14'397'300.00	0.34	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	2'000	0	2'000 CHF	99.85%	1'997'000.00	0.05	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	0	2'000	0	2'000 CHF	98.80%	1'976'000.00	0.05	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	1'875	0	0	1'875 CHF	97.70%	1'831'875.00	0.04	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	0	1'500	0	1'500 CHF	97.90%	1'468'500.00	0.03	a)
CH1179534941	1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32	5'000	0	0	5'000 CHF	98.95%	4'947'500.00	0.12	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	5'300	4'000	0	9'300 CHF	99.85%	9'286'050.00	0.22	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	7'400	0	0	7'400 CHF	99.79%	7'384'460.00	0.17	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	14'950	7'500	0	22'450 CHF	99.30%	22'292'850.00	0.52	a)
CH1189217735	1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25	1'500	0	0	1'500 CHF	99.30%	1'489'500.00	0.03	a)
CH1189217743	1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25	4'500	0	0	4'500 CHF	99.37%	4'471'650.00	0.10	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	9'500	1'000	0	10'500 CHF	100.83%	10'587'150.00	0.25	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	25'500	3'000	2'500	26'000 CHF	107.25%	27'885'000.00	0.65	a)
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	29'000	0	0	29'000 CHF	100.61%	29'176'900.00	0.68	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	12'000	0	0	12'000 CHF	102.00%	12'240'000.00	0.29	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	16'300	0	0	16'300 CHF	104.15%	16'976'450.00	0.40	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	10'000	1'000	0	11'000 CHF	99.95%	10'994'500.00	0.26	a)
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	3'650	4'500	2'500	5'650 CHF	100.60%	5'683'900.00	0.13	a)
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	14'600	12'000	0	26'600 CHF	100.70%	26'786'200.00	0.63	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	2'500	0	0	2'500 CHF	105.65%	2'641'250.00	0.06	a)
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	10'000	0	5'000	5'000 CHF	101.35%	5'067'500.00	0.12	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	5'100	0	0	5'100 CHF	101.80%	5'191'800.00	0.12	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	12'900	0	0	12'900 CHF	105.25%	13'577'250.00	0.32	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	0	5'000	0	5'000 CHF	105.69%	5'284'500.00	0.12	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	5'000	2'500	550	6'950 CHF	111.15%	7'724'925.00	0.18	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	10'700	4'000	0	14'700 CHF	121.00%	17'787'000.00	0.42	a)
CH1196217017	2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37	2'500	0	0	2'500 CHF	110.50%	2'762'500.00	0.06	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	7'370	0	0	7'370 CHF	114.30%	8'423'910.00	0.20	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	1'200	0	1'200 CHF	101.55%	1'218'600.00	0.03	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	9'700	0	0	9'700 CHF	105.28%	10'212'160.00	0.24	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	0	9'700	0	9'700 CHF	99.78%	9'678'660.00	0.23	a)
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	1'500	0	0	1'500 CHF	99.15%	1'487'250.00	0.03	a)
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	4'000	0	0	4'000 CHF	103.30%	4'132'000.00	0.10	a)
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	10'000	0	0	10'000 CHF	100.81%	10'081'000.00	0.24	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	10'000	0	3'000	7'000 CHF	107.48%	7'523'600.00	0.18	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	5'000	0	0	5'000 CHF	100.95%	5'047'500.00	0.12	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	0	1'000	0	1'000 CHF	104.70%	1'047'000.00	0.02	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	1'000	800	0	1'800 CHF	111.13%	2'000'340.00	0.05	a)
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	6'800	850	0	7'650 CHF	114.40%	8'751'600.00	0.21	a)
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	0	1'000	0	1'000 CHF	101.60%	1'016'000.00	0.02	a)
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	6'000	0	0	6'000 CHF	101.65%	6'099'000.00	0.14	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	16'000	0	0	16'000 CHF	99.15%	15'864'000.00	0.37	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	2'750	0	0	2'750 CHF	102.15%	2'809'125.00	0.07	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	4'700	0	0	4'700 CHF	104.20%	4'897'400.00	0.11	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	2'500	3'000	0	5'500 CHF	105.35%	5'794'250.00	0.14	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	5'000	0	0	5'000 CHF	116.95%	5'847'500.00	0.14	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	5'000	0	0	5'000 CHF	102.35%	5'117'500.00	0.12	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	3'000	0	0	3'000 CHF	105.57%	3'167'100.00	0.07	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	17'500	0	2'500	15'000 CHF	109.81%	16'471'500.00	0.39	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	3'500	1'500	0	5'000 CHF	108.30%	5'415'000.00	0.13	a)
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	0	500	0	500 CHF	104.55%	522'750.00	0.01	a)
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	500	0	500 CHF	103.45%	517'250.00	0.01	a)
CH1230759487	3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25	2'000	0	0	2'000 CHF	101.95%	2'039'000.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	500	0	500 CHF	102.75%	513'750.00	0.01	a)
CH1231094355	2.1250 % KBLUZE 2 1/8 01/30/32	21'300	7'500	0	28'800 CHF	104.90%	30'211'200.00	0.71	a)
CH1231094389	1.9000 % KBLUZE 1.9 06/19/31	5'000	0	0	5'000 CHF	102.95%	5'147'500.00	0.12	a)
CH1231094397	2.0000 % KBLUZE 2 11/19/38	12'000	2'000	6'000	8'000 CHF	106.80%	8'544'000.00	0.20	a)
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	5'000	0	0	5'000 CHF	100.52%	5'026'000.00	0.12	a)
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	7'000	0	0	7'000 CHF	102.08%	7'145'600.00	0.17	a)
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	10'150	0	0	10'150 CHF	103.66%	10'521'490.00	0.25	a)
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	0	2'000	0	2'000 CHF	105.75%	2'115'000.00	0.05	a)
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	5'000	0	0	5'000 CHF	108.84%	5'442'000.00	0.13	a)
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	2'200	0	0	2'200 CHF	104.75%	2'304'500.00	0.05	a)
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	10'000	0	0	10'000 CHF	103.05%	10'305'000.00	0.24	a)
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	3'000	0	1'000	2'000 CHF	103.54%	2'070'800.00	0.05	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	15'460	0	0	15'460 CHF	106.95%	16'534'470.00	0.39	a)
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	5'250	3'500	0	8'750 CHF	104.25%	9'121'875.00	0.21	a)
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	12'000	0	0	12'000 CHF	103.75%	12'450'000.00	0.29	a)
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	6'500	0	0	6'500 CHF	101.90%	6'623'500.00	0.16	a)
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	2'500	1'000	1'200	2'300 CHF	102.95%	2'367'850.00	0.06	a)
CH1242301286	2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32	3'850	0	3'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018822	2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25	4'500	0	1'000	3'500 CHF	101.04%	3'536'400.00	0.08	a)
CH1243651945	2.7500 % KWLILI 2 3/4 03/01/30	2'550	0	0	2'550 CHF	105.45%	2'688'975.00	0.06	a)
CH1249415998	2.4586 % UBS 2.4586 11/22/24 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	100.55%	3'016'500.00	0.07	a)
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	5'500	0	0	5'500 CHF	104.71%	5'759'050.00	0.14	a)
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	8'500	0	0	8'500 CHF	107.20%	9'112'000.00	0.21	a)
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	1'500	0	0	1'500 CHF	100.95%	1'514'250.00	0.04	a)
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	3'000	0	0	3'000 CHF	107.60%	3'228'000.00	0.08	a)
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	5'140	0	0	5'140 CHF	103.45%	5'317'330.00	0.12	a)
CH1253456060	2.1250 % SIKASW 2 1/8 10/11/24	5'000	0	0	5'000 CHF	100.21%	5'010'500.00	0.12	a)
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2 7/8 04/21/27	0	5'000	0	5'000 CHF	102.30%	5'115'000.00	0.12	a)
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	4'000	2'000	0	6'000 CHF	106.55%	6'393'000.00	0.15	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	32'500	3'000	0	35'500 CHF	106.95%	37'967'250.00	0.89	a)
CH1255924453	2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29	2'800	0	0	2'800 CHF	103.85%	2'907'800.00	0.07	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	2'500	0	2'500 CHF	103.60%	2'590'000.00	0.06	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	4'650	0	0	4'650 CHF	136.45%	6'344'925.00	0.15	a)
CH1266847131	2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30	10'800	0	1'250	9'550 CHF	104.45%	9'974'975.00	0.23	a)
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	3'750	0	3'750 CHF	109.00%	4'087'500.00	0.10	a)
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	6'000	0	0	6'000 CHF	103.20%	6'192'000.00	0.15	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	4'050	0	0	4'050 CHF	105.65%	4'278'825.00	0.10	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	850	0	0	850 CHF	103.85%	882'725.00	0.02	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	3'500	0	0	3'500 CHF	105.80%	3'703'000.00	0.09	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	6'470	0	0	6'470 CHF	103.85%	6'719'095.00	0.16	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	2'770	0	0	2'770 CHF	101.35%	2'807'395.00	0.07	a)
CH1274703144	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44	0	5'500	0	5'500 CHF	101.95%	5'607'250.00	0.13	a)
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	1'250	0	0	1'250 CHF	108.45%	1'355'625.00	0.03	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	6'300	3'000	0	9'300 CHF	110.53%	10'279'290.00	0.24	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	11'700	0	0	11'700 CHF	103.90%	12'156'300.00	0.29	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	2'500	0	2'500 CHF	106.39%	2'659'750.00	0.06	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	4'000	0	4'000 CHF	107.20%	4'288'000.00	0.10	a)
CH1280155461	1.8000 % SGKNSW 1.8 07/13/33	21'000	0	0	21'000 CHF	103.00%	21'630'000.00	0.51	a)
CH1280994307	2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26	0	1'000	0	1'000 CHF	101.70%	1'017'000.00	0.02	a)
CH1289657111	2.0000 % EMMI 2 09/22/28	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222400	2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29	5'000	1'250	0	6'250 CHF	103.20%	6'450'000.00	0.15	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	6'000	0	1'500	4'500 CHF	107.20%	4'824'000.00	0.11	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	2'500	0	2'500 CHF	105.75%	2'643'750.00	0.06	a)
CH1290222566	2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31	0	1'500	0	1'500 CHF	104.40%	1'566'000.00	0.04	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	4'500	0	0	4'500 CHF	102.75%	4'623'750.00	0.11	a)
CH1290870877	2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33	3'500	0	0	3'500 CHF	106.50%	3'727'500.00	0.09	a)
CH1290870950	2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26	6'375	0	6'375	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	3'850	1'900	0	5'750 CHF	104.15%	5'988'625.00	0.14	a)
CH1291601958	1.6000 % KBLUZE 1.6 03/08/44 MAY	0	4'000	0	4'000 CHF	102.10%	4'083'800.00	0.10	a)
CH1293237975	1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26	7'500	0	0	7'500 CHF	101.40%	7'605'000.00	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1293237991	2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33	5'000	0	0	5'000 CHF	103.80%	5'190'000.00	0.12	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	5'000	0	0	5'000 CHF	102.55%	5'127'500.00	0.12	a)
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	5'000	0	1'100	3'900 CHF	100.70%	3'927'300.00	0.09	a)
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	5'000	4'000	0	9'000 CHF	104.15%	9'373'500.00	0.22	a)
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	10'000	0	0	10'000 CHF	105.55%	10'555'000.00	0.25	a)
CH1300277881	2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28	0	5'000	0	5'000 CHF	102.10%	5'105'000.00	0.12	a)
CH1305916731	2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31	0	3'750	0	3'750 CHF	105.55%	3'958'125.00	0.09	a)
CH1305916764	1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	500	0	500 CHF	105.55%	527'750.00	0.01	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	3'500	0	3'500 CHF	102.35%	3'582'250.00	0.08	a)
CH1305916830	1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26	0	3'000	0	3'000 CHF	100.55%	3'016'500.00	0.07	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	17'500	0	17'500 CHF	100.02%	17'503'500.00	0.41	a)
CH1306117131	1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30	0	15'000	0	15'000 CHF	100.05%	15'007'500.00	0.35	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	8'335	0	8'335 CHF	100.35%	8'364'172.50	0.20	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	2'000	0	2'000 CHF	103.70%	2'074'000.00	0.05	a)
CH1307121272	2.3750 % KWLILJ 2 3/8 12/05/29	0	3'000	0	3'000 CHF	103.30%	3'099'000.00	0.07	a)
CH1310346270	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 MAR	0	12'000	12'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346288	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346312	1.3500 % ZURCTY 1.35 03/24/45	0	8'500	0	8'500 CHF	101.62%	8'637'700.00	0.20	a)
CH1314941423	1.9500 % BARY 1.95 01/24/28	0	3'150	3'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1314941431	2.3000 % BARY 2.3 01/23/32	0	5'260	5'260	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968454	2.0000 % NANTDR 2 05/26/34	0	5'000	0	5'000 CHF	101.90%	5'095'000.00	0.12	a)
CH1319968496	1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30	0	2'000	0	2'000 CHF	100.25%	2'005'000.00	0.05	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	12'000	0	12'000 CHF	100.46%	12'055'200.00	0.28	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	7'300	0	7'300 CHF	100.95%	7'369'350.00	0.17	a)
CH1319968553	2.0000 % ZKB 2 03/22/30	0	2'000	0	2'000 CHF	101.50%	2'030'000.00	0.05	a)
CH1319968561	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/22/33	0	8'000	0	8'000 CHF	102.35%	8'188'000.00	0.19	a)
CH1319968587	2.3750 % BAER 2 3/8 04/04/31	0	5'000	0	5'000 CHF	101.60%	5'080'000.00	0.12	a)
CH1319968595	1.5500 % STFPWG 1.55 04/02/32	0	4'100	0	4'100 CHF	100.65%	4'126'650.00	0.10	a)
CH1319968603	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 MAR	0	10'000	10'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1319968645	1.5000 % KBSH 1 1/2 04/25/36	0	8'000	0	8'000 CHF	100.35%	8'028'080.00	0.19	a)
CH1319968686	1.4500 % PFZENT 1.45 12/07/33 592	0	5'000	0	5'000 CHF	100.41%	5'020'500.00	0.12	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	1'100	0	1'100 CHF	100.00%	1'100'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	10'000	0	10'000 CHF	100.35%	10'035'000.00	0.24	a)
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	10'000	0	10'000 CHF	102.60%	10'260'000.00	0.24	a)
CH1325037047	1.9775 % CAABNK 1.9775 05/14/27	0	5'000	0	5'000 CHF	100.03%	5'001'550.00	0.12	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	5'180	0	5'180 CHF	108.90%	5'641'020.00	0.13	a)
CH1340267090	1.3500 % KBAARG 1.35 04/30/31	0	5'850	0	5'850 CHF	99.54%	5'823'324.00	0.14	a)
CH1341034960	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 07/20/34 752	0	5'000	0	5'000 CHF	100.82%	5'040'900.00	0.12	a)
CH1341034978	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/19/39 753	0	6'000	0	6'000 CHF	101.03%	6'061'800.00	0.14	a)
CH1341035009	1.5025 % SLHNVX 1.5025 04/26/30	0	2'550	2'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1341035017	1.6575 % SLHNVX 1.6575 04/26/33	0	2'250	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH							2'985'090'365.70	70.07	
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.00%	1'920'000.00	0.05	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	99.46%	994'600.00	0.02	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	99.28%	5'956'800.00	0.14	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	0	4'200	0	4'200 CHF	98.35%	4'130'700.00	0.10	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	90.65%	1'813'000.00	0.04	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	90.30%	2'709'000.00	0.06	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'000	3'000	1'000	3'000 CHF	97.56%	2'926'800.00	0.07	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	95.60%	2'390'000.00	0.06	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	95.50%	5'730'000.00	0.13	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	6'600	0	0	6'600 CHF	96.00%	6'336'000.00	0.15	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	8'000	0	3'500	4'500 CHF	96.15%	4'326'750.00	0.10	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	101.25%	6'075'000.00	0.14	a)
CL							45'308'650.00	1.06	
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	10'550	0	10'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	6'700	0	0	6'700 CHF	94.55%	6'334'850.00	0.15	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	1'300	1'300	0	2'600 CHF	96.30%	2'503'800.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	2'530	0	1'500	1'030 CHF	96.85%	997'555.00	0.02	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	92.90%	1'858'000.00	0.04	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	0	1'500	0	1'500 CHF	94.30%	1'414'500.00	0.03	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	94.65%	8'897'100.00	0.21	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	89.95%	7'196'000.00	0.17	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	13'000	0	0	13'000 CHF	93.85%	12'200'500.00	0.29	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	9'400	0	0	9'400 CHF	93.60%	8'798'400.00	0.21	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	90.00%	1'800'000.00	0.04	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	10'750	0	0	10'750 CHF	82.20%	8'836'500.00	0.21	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	6'200	0	0	6'200 CHF	95.40%	5'914'800.00	0.14	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	7'500	0	3'000	4'500 CHF	91.95%	4'137'750.00	0.10	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.55%	10'255'000.00	0.24	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	103.60%	5'180'000.00	0.12	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	5'000	0	1'000	4'000 CHF	100.80%	4'032'000.00	0.09	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	104.55%	4'182'000.00	0.10	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.65%	1'016'500.00	0.02	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.50%	5'075'000.00	0.12	a)
DE							100'630'255.00	2.36	
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	1'500	0	0	1'500 CHF	111.35%	1'670'250.00	0.04	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	79.25%	3'962'500.00	0.09	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	102.35%	10'235'000.00	0.24	a)
DK							15'867'750.00	0.37	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'300	1'900	0	3'200 CHF	99.63%	3'188'160.00	0.07	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'500	4'000	0	6'500 CHF	95.25%	6'191'250.00	0.15	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'400	400	0	2'800 CHF	96.40%	2'699'200.00	0.06	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	9'900	0	9'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'800	0	0	2'800 CHF	96.10%	2'690'800.00	0.06	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	101.15%	7'080'500.00	0.17	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.25%	5'062'500.00	0.12	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	9'500	0	0	9'500 CHF	104.75%	9'951'250.00	0.23	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	102.15%	4'086'000.00	0.10	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	11'000	0	11'000 CHF	103.05%	11'335'500.00	0.27	a)
ES							52'285'160.00	1.23	
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	100.10%	5'005'000.00	0.12	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	101.60%	10'160'000.00	0.24	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	11'000	0	0	11'000 CHF	102.95%	11'324'500.00	0.27	a)
FI							26'489'500.00	0.62	
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	13'525	0	0	13'525 CHF	101.85%	13'775'212.50	0.32	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	9'440	0	9'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	9'200	0	0	9'200 CHF	100.25%	9'223'000.00	0.22	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.02	a)
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	98.20%	2'455'000.00	0.06	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	97.00%	6'790'000.00	0.16	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	99.27%	5'956'200.00	0.14	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	2'500	0	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	99.35%	1'490'250.00	0.03	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	96.25%	1'925'000.00	0.05	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	95.50%	1'910'000.00	0.04	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	4'000	0	4'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	7'000	0	0	7'000 CHF	93.75%	6'562'500.00	0.15	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.02	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	0	2'600 CHF	95.70%	2'488'200.00	0.06	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	3'000	5'000	0	8'000 CHF	93.65%	7'492'000.00	0.18	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	97.05%	970'500.00	0.02	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	4'800	0	0	4'800 CHF	93.85%	4'504'800.00	0.11	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	3'000	2'000	0	5'000 CHF	92.80%	4'640'000.00	0.11	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	95.30%	7'624'000.00	0.18	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	8'800	0	0	8'800 CHF	95.25%	8'382'000.00	0.20	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	5'400	0	0	5'400 CHF	104.60%	5'648'400.00	0.13	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	10'500	4'600	0	15'100 CHF	94.35%	14'246'850.00	0.33	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	1'260	0	0	1'260 CHF	96.50%	1'215'900.00	0.03	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	94.15%	3'766'000.00	0.09	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	9'000	0	0	9'000 CHF	97.50%	8'775'000.00	0.21	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	4'500	0	0	4'500 CHF	101.90%	4'585'500.00	0.11	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	3'800	0	0	3'800 CHF	101.75%	3'866'500.00	0.09	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	104.45%	10'445'000.00	0.25	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	6'000	0	0	6'000 CHF	101.05%	6'063'000.00	0.14	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	104.45%	2'820'150.00	0.07	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	2'500	0	0	2'500 CHF	102.00%	2'550'000.00	0.06	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 CHF	101.60%	3'048'000.00	0.07	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	104.70%	10'470'000.00	0.25	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	104.70%	1'047'000.00	0.02	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	10'000	0	2'000	8'000 CHF	103.50%	8'280'000.00	0.19	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	5'000	3'000	0	8'000 CHF	105.50%	8'440'000.00	0.20	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	10'000	0	0	10'000 CHF	104.80%	10'480'000.00	0.25	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.35%	5'117'500.00	0.12	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	102.15%	10'215'000.00	0.24	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	102.00%	4'080'000.00	0.10	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPF 1.5125 03/06/36 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	101.10%	4'044'000.00	0.09	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	5'000	0	2'000	3'000 CHF	102.95%	3'088'500.00	0.07	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.80%	5'040'000.00	0.12	a)
CH1331113535	2.0450 % BPCEGP 2.045 03/15/32 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.97%	5'048'400.00	0.12	a)
CH1336918763	2.2250 % ALDFP 2.225 03/28/29 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	101.11%	5'055'600.00	0.12	a)
CH1341056450	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 APR	0	2'600	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
FR							235'569'462.50	5.53	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.58%	995'800.00	0.02	a)
CH0485445982	0.0000 % NWDIE 0 07/11/25 EMTN	6'150	0	0	6'150 CHF	98.29%	6'044'835.00	0.14	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	12'000	4'400	0	16'400 CHF	95.75%	15'703'000.00	0.37	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	16'200	0	0	16'200 CHF	95.55%	15'479'100.00	0.36	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	5'000	400	0	5'400 CHF	94.05%	5'078'700.00	0.12	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	0	2'300	0	2'300 CHF	98.88%	2'274'240.00	0.05	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	1'600	1'000	0	2'600 CHF	99.75%	2'593'500.00	0.06	a)
CH1202242223	1.5203 % NWDIE 1.5203 12/17/29	0	1'000	0	1'000 CHF	100.35%	1'003'500.00	0.02	a)
CH1204175124	1.9150 % NWDIE 1.915 09/08/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	100.55%	4'022'000.00	0.09	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	101.45%	2'029'000.00	0.05	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	2'600	1'000	0	3'600 CHF	104.15%	3'749'400.00	0.09	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	3'000	0	0	3'000 CHF	101.45%	3'043'500.00	0.07	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	4'000	0	1'200	2'800 CHF	101.40%	2'839'200.00	0.07	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	5'000	5'400	0	10'400 CHF	102.95%	10'706'800.00	0.25	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 CHF	100.35%	4'014'000.00	0.09	a)
GB							79'576'575.00	1.87	
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	8'400	0	0	8'400 CHF	99.40%	8'349'600.00	0.20	a)
IE							8'349'600.00	0.20	
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	99.95%	5'997'000.00	0.14	a)
JE							5'997'000.00	0.14	
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	99.75%	1'995'000.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	3'000	2'000	3'000	2'000 CHF	99.17%	1'983'400.00	0.05	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	2'500	0	0	2'500 CHF	98.25%	2'456'250.00	0.06	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	98.88%	2'373'120.00	0.06	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	17'000	0	0	17'000 CHF	98.15%	16'685'500.00	0.39	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	5'000	0	0	5'000 CHF	100.89%	5'044'500.00	0.12	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	4'545	0	0	4'545 CHF	100.80%	4'581'360.00	0.11	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	5'000	0	0	5'000 CHF	102.25%	5'112'500.00	0.12	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	4'300	0	4'300 CHF	101.60%	4'368'800.00	0.10	a)
KR							44'600'430.00	1.05	
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	4'600	1'150	2'500	3'250 CHF	99.30%	3'227'250.00	0.08	a)
KY							3'227'250.00	0.08	
CH0461238880	0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29	0	2'000	0	2'000 CHF	93.10%	1'862'000.00	0.04	a)
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	1'500	0	0	1'500 CHF	90.70%	1'360'500.00	0.03	a)
CH1212189158	2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	107.95%	2'159'000.00	0.05	a)
CH1243651929	2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117040	2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30	0	5'000	0	5'000 CHF	102.95%	5'147'500.00	0.12	a)
CH1323274055	2.0000 % LGT 2 02/15/34 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.02	a)
LI							11'551'000.00	0.27	
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
LU							0.00	0.00	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	5'350	1'000	0	6'350 CHF	103.85%	6'594'475.00	0.15	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	104.40%	2'088'000.00	0.05	a)
CH0315593860	0.3000 % ABNANV 0.3 12/18/24 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	7'750	0	0	7'750 CHF	99.66%	7'723'650.00	0.18	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	0	3'600	0	3'600 CHF	90.90%	3'272'400.00	0.08	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	95.05%	2'471'300.00	0.06	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	80.30%	4'015'000.00	0.09	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	10'000	0	0	10'000 CHF	95.80%	9'580'000.00	0.22	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	2'000	0	2'000 CHF	92.10%	1'842'000.00	0.04	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.80%	1'976'000.00	0.05	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	102.40%	5'120'000.00	0.12	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	2'725	545	0	3'270 CHF	101.60%	3'322'320.00	0.08	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	5'000	7'000	0	12'000 CHF	103.15%	12'378'000.00	0.29	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	101.30%	4'052'000.00	0.10	a)
NL							64'435'145.00	1.51	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	7'000	0	7'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	97.20%	1'944'000.00	0.05	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	8'300	0	0	8'300 CHF	98.80%	8'200'400.00	0.19	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	5'000	0	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	8'600	0	0	8'600 CHF	102.20%	8'789'200.00	0.21	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.95%	5'147'500.00	0.12	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	102.20%	4'088'000.00	0.10	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.90%	5'095'000.00	0.12	a)
CH1335850272	1.1800 % KBN 1.18 05/02/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	99.49%	9'948'500.00	0.23	a)
CH1348614038	1.6950 % DNBNO 1.695 05/15/30 EMTN	0	5'000	0	5'000 CHF	100.00%	5'000'000.00	0.12	a)
NO							48'212'600.00	1.13	
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	98.34%	1'966'800.00	0.05	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	3'000	6'000	0	9'000 CHF	94.00%	8'460'000.00	0.20	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	3'950	0	0	3'950 CHF	93.85%	3'707'075.00	0.09	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	450	4'000	450	4'000 CHF	94.05%	3'762'000.00	0.09	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	3'750	0	0	3'750 CHF	103.95%	3'898'125.00	0.09	a)
NZ							21'794'000.00	0.51	
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	6'500	0	0	6'500 CHF	94.25%	6'126'250.00	0.14	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	4'000	0	0	4'000 CHF	103.55%	4'142'000.00	0.10	a)
SE							11'239'750.00	0.26	
CH1344316703	1.9150 % SLOVAK 1.915 05/10/34	0	10'000	0	10'000 CHF	100.07%	10'006'500.00	0.23	a)
SK							10'006'500.00	0.23	
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	0	1'500	0	1'500 CHF	99.92%	1'498'800.00	0.04	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	8'010	2'000	0	10'010 CHF	99.45%	9'954'945.00	0.23	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.40%	1'988'000.00	0.05	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	99.15%	1'983'000.00	0.05	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	8'000	3'500	0	11'500 CHF	98.60%	11'339'000.00	0.27	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	6'000	0	6'000 CHF	95.70%	5'742'000.00	0.13	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	8'000	0	0	8'000 CHF	97.60%	7'808'000.00	0.18	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'250	4'000	0	5'250 CHF	95.65%	5'021'625.00	0.12	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	8'800	3'000	0	11'800 CHF	95.00%	11'210'000.00	0.26	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	10'000	2'000	0	12'000 CHF	92.05%	11'046'000.00	0.26	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	0	5'000	2'500	2'500 CHF	92.30%	2'307'500.00	0.05	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'000	5'000	2'000	6'000 CHF	93.70%	5'622'000.00	0.13	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	6'500	0	0	6'500 CHF	92.75%	6'028'750.00	0.14	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	93.95%	1'127'400.00	0.03	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'400	7'000	0	10'400 CHF	93.55%	9'729'200.00	0.23	a)
CH1290871040	1.8750 % MET 1 7/8 04/08/31 EMTN	0	10'000	0	10'000 CHF	100.35%	10'035'000.00	0.24	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	10'000	0	10'000 CHF	102.65%	10'265'000.00	0.24	a)
CH1341035041	1.8750 % NYLIFE 1 7/8 05/07/32 GMTN	0	13'000	0	13'000 CHF	100.61%	13'079'430.00	0.31	a)
US							125'785'650.00	2.95	
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	6'600	0	0	6'600 CHF	103.45%	6'827'700.00	0.16	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	98.40%	2'952'000.00	0.07	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	0	7'000	0	7'000 CHF	97.90%	6'853'000.00	0.16	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	4'000	2'200	0	6'200 CHF	94.85%	5'880'700.00	0.14	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	2'000	0	0	2'000 CHF	95.85%	1'917'000.00	0.04	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	3'050	0	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	6'000	7'000	0	13'000 CHF	94.55%	12'291'500.00	0.29	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	4'015	400	0	4'415 CHF	98.73%	4'358'929.50	0.10	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'500	0	500	1'000 CHF	95.90%	959'000.00	0.02	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	1'000	1'500	0	2'500 CHF	87.10%	2'177'500.00	0.05	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'200	500	1'500	200 CHF	92.20%	184'400.00	0.00	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	92.60%	4'630'000.00	0.11	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	7'000	0	0	7'000 CHF	90.35%	6'324'500.00	0.15	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	3'200	0	0	3'200 CHF	96.45%	3'086'400.00	0.07	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	101.00%	5'050'000.00	0.12	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	0	3'000	0	3'000 CHF	102.42%	3'072'600.00	0.07	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	4'000	0	0	4'000 CHF	101.35%	4'054'000.00	0.10	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	5'000	0	0	5'000 CHF	102.35%	5'117'500.00	0.12	a)
CH1344316711	2.5925 % FNPLAT 2.5925 11/15/27	0	1'500	0	1'500 CHF	100.08%	1'501'170.00	0.04	a)
XS							77'237'899.50	1.81	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Swaps							0.00	0.00	
08/32	IRS FIX LEG 1.8375% P.A. CHF	-30'000	30'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	30'000	0	30'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/32	IRS FIX LEG 1.855% P.A. CHF	-15'000	15'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/32	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	15'000	0	15'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
08/33	IRS FIX LEG 1.79% P.A. CHF	-20'000	20'000	0	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
08/33	IRS FLOATING LEG - CHF - SARON-OIS-COMPOUND	20'000	0	20'000	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

Kurswert
CHF

in %
7)

Bankguthaben auf Sicht	0.34	0.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4'228'712'357.70	99.26
Sonstige Vermögenswerte	31'319'073.12	0.74
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'260'031'431.16	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-30'446'127.71	
Andere Verbindlichkeiten	-266'222.93	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'229'319'080.52	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in %)
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);	4'228'712'357.70	99.26
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

USD	1 = CHF	0.91715000
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
MT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

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: 01.11.2023 - 30.04.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	0.750	1.200	0.550	0.200	2.000
BA CHF	0.480	0.900	0.280	0.200	2.000
CT CHF	0.450	0.750	0.250	0.200	2.000
DT CHF	0.350	0.700	0.250	0.100	2.000
GT CHF	0.280	0.600	0.180	0.100	2.000
MT CHF	-	-	-	-	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

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

Swiss Bond Index (SBI)® AAA-BBB Total Return

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 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert 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 in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder 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, 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 Markttrendite 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 Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken.

Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 19 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen 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 Quoten am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.