

# SWISSCANTO (CH) BOND FUND RESPONSIBLE GLOBAL AGGREGATE (EX 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»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
ASTT CHF	43450521	CHF
NTH1 CHF	55982810	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://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	26
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	27
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	27
7	Pauschale Verwaltungskommission	27
8	Benchmark	28
9	TER	28
10	Fussnoten	28
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	29

# 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
<b>Konsolidiert</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'652'325'244.12	1'030'954'228.75	876'857'843.81	946'998'416.45
<b>Klasse ASTT CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		445'834'625.31	451'127'851.98	501'818'733.87	598'744'671.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'112'339.486	5'456'286.314	5'621'120.954	5'849'323.507
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		87.2076	82.6804	89.2738	102.3614
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		87.2076	82.7548	89.3898	102.2078
Thesaurierung je Anteil		-	1.22	1.17	1.46
Total Expense Ratio (TER)		0.45 %	0.45 %	0.45 %	0.45 %
<b>Klasse NTH1 CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'206'490'618.81	579'826'376.77	375'039'109.94	348'253'744.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'242'988.583	7'026'874.744	4'416'727.933	3'526'835.063
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		84.7077	82.5155	84.9133	98.7440
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		84.7077	82.5898	85.0237	98.5959
Thesaurierung je Anteil		-	1.59	1.54	1.85
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 ASTT CHF	5.48 %	-3.80 %	-14.34 %	-1.52 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 15.09.2020)	3.33 %	3.00 %	-12.97 %	-1.72 %
Benchmark Hedge	2.71 %	-	-	-
Benchmark	5.25 %	-3.89 %	-14.97 %	-1.77 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	-	0.50 %	0.99 %	0.44 %

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 ASTT CHF	0.23 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 15.09.2020)	0.62 %

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	25'977'665.79	12'247'812.13
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'618'320'049.93	1'032'216'769.02
Derivative Finanzinstrumente	-5'368'931.01	-2'118'091.97
Sonstige Vermögenswerte	13'577'231.54	9'198'209.33
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'652'506'016.25</b>	<b>1'051'544'698.51</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-20'410'707.02
Andere Verbindlichkeiten	-180'772.13	-179'762.74
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'652'325'244.12</b>	<b>1'030'954'228.75</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse ASTT CHF	von bis	Lancierung	01.11.2022
		30.04.2024	31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'456'286.314	5'621'120.954
Ausgegebene Anteile		240'654.339	513'512.111
Zurückgenommene Anteile		-584'601.167	-678'346.751
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>5'112'339.486</b>	<b>5'456'286.314</b>

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.11.2023	01.11.2022
		30.04.2024	31.10.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'026'874.744	4'416'727.933
Ausgegebene Anteile		4'192'970.237	3'515'738.266
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		3'232'285.736	-
Zurückgenommene Anteile		-209'142.134	-905'591.455
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'242'988.583</b>	<b>7'026'874.744</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	13.11.2023	33'235'875.98	397'300.745
Klasse NTH1 CHF	19.03.2024	3'616'287.17	42'086.995
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	54'905'712.95	636'503.847
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	56'832'224.33	658'837.259
Klasse NTH1 CHF	26.03.2024	129'181'353.91	1'497'556.890

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.11.2023	01.11.2022
		30.04.2024	31.10.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'030'954'228.75	876'857'843.81
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'565'850.53	-2'922'334.13
Saldo aus dem Anteilverkehr		585'467'763.34	208'889'312.34
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		41'469'102.56	-51'870'593.27
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'652'325'244.12</b>	<b>1'030'954'228.75</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.11.2023 30.04.2024</b>	<b>01.11.2022 31.10.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		214'811.19	177'494.40
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-9'903.60	-24'600.90
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		18'048'808.20	18'569'836.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'926'246.26	2'213'464.54
<b>Total Ertrag</b>		<b>23'179'962.05</b>	<b>20'936'194.79</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-1'094.75	0.00
Reglementarische Vergütungen		-1'008'815.16	-2'150'640.79
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-335'604.57	-897'251.97
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'345'514.48</b>	<b>-3'047'892.76</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>21'834'447.57</b>	<b>17'888'302.03</b>
<b>Realisierter Erfolg</b>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-43'640'035.58	-35'065'588.18
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		355'533.29	575'354.14
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-21'450'054.72</b>	<b>-16'601'932.01</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		62'919'157.28	-35'268'661.26
<b>Gesamterfolg</b>		<b>41'469'102.56</b>	<b>-51'870'593.27</b>

# 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>1'618'320'049.93</b>	<b>97.93</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'618'320'049.93</b>	<b>97.93</b>	
AU3CB0250512	4.7500 % EBIUH 4 3/4 02/09/28 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	97.38%	579'930.04	0.04	a)
XS2231705950	4.0500 % EBIUH 4.05 09/24/25 EMTN	14'690	0	14'690	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2287867720	3.1500 % FABUH 3.15 01/29/26 EMTN	23'000	29'000	0	52'000 CNY	99.24%	6'525'530.17	0.39	a)
XS2297626645	0.8750 % FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN	0	700	0	700 GBP	92.59%	744'326.60	0.05	a)
XS2339427820	0.8750 % ETISLT 0 7/8 05/17/33 EMTN	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2339828498	3.5000 % EBIUH 3 1/2 05/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	99.59%	2'518'772.10	0.15	a)
XS2352309681	1.6390 % EMDEBK 1.639 06/15/26 EMTN	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357280101	3.6700 % EBIUH 3.67 07/13/28 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	99.39%	1'256'793.78	0.08	a)
XS2466186074	1.6250 % FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	94.42%	1'666'668.56	0.10	a)
XS2623206187	5.0840 % MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS	3'000	0	0	3'000 USD	89.29%	2'456'632.13	0.15	a)
XS2651619285	4.8750 % MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	95.27%	873'750.46	0.05	a)
XS2677030194	5.5000 % ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN	3'000	0	1'000	2'000 USD	99.88%	1'832'007.13	0.11	a)
XS2707149600	5.8750 % MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS	6'950	0	4'050	2'900 USD	102.70%	2'731'468.05	0.17	a)
XS2765576538	5.0000 % FABUH 5 02/28/29 EMTN	0	9'875	975	8'900 USD	97.82%	7'984'607.93	0.48	a)
XS2811094213	5.5000 % ADGB 5 1/2 04/30/54 REGS	0	11'400	0	11'400 USD	96.97%	10'138'394.38	0.61	a)
<b>AE</b>							<b>39'308'881.33</b>	<b>2.38</b>	
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	3'000	0	1'500	1'500 EUR	98.88%	1'454'555.99	0.09	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	3'000	0	0	3'000 EUR	94.48%	2'779'575.56	0.17	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	1'800	0	0	1'800 EUR	72.99%	1'288'438.70	0.08	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	2'500	4'500	0	7'000 EUR	84.69%	5'813'830.57	0.35	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	7'000	2'000	0	9'000 EUR	59.47%	5'249'005.11	0.32	a)
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	0	10'000	0	10'000 EUR	82.09%	8'050'694.73	0.49	a)
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	1'600	0	0	1'600 EUR	88.27%	1'384'985.45	0.08	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	1'000	0	0	1'000 EUR	76.74%	752'515.48	0.05	a)
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	3'200	200	0	3'400 EUR	99.69%	3'323'767.77	0.20	a)
XS2320746394	0.9000 % VERAUV 0.9 04/01/41	0	700	0	700 EUR	64.63%	443'691.41	0.03	a)
<b>AT</b>							<b>30'541'060.77</b>	<b>1.85</b>	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	3'900	0	3'900	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	5'500	2'000	2'500	5'000 AUD	77.57%	2'309'965.02	0.14	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	6'000	0	2'000	4'000 AUD	54.47%	1'297'658.75	0.08	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	0	2'000	0	2'000 AUD	81.42%	969'819.64	0.06	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	3'500	2'500	2'500	3'500 AUD	85.08%	1'773'432.81	0.11	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	3'900	0	2'700	1'200 AUD	85.31%	609'699.27	0.04	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	4'000	0	1'000	3'000 AUD	75.75%	1'353'318.98	0.08	a)
AU3CB0247393	3.7500 % SGSPA 3 3/4 09/27/24 MTN	0	500	0	500 AUD	99.40%	295'997.95	0.02	a)
AU3SG0002447	1.7500 % SAFA 1 3/4 05/24/34	1'300	0	0	1'300 AUD	73.09%	565'890.51	0.03	a)
AU3SG0002553	1.7500 % NSWTC 1 3/4 03/20/34	2'000	0	0	2'000 AUD	73.59%	876'556.30	0.05	a)
AU3SG0002579	2.0000 % TCY 2 09/17/35	0	4'500	0	4'500 AUD	71.30%	1'910'746.11	0.12	a)
AU3SG0002934	5.2500 % TCY 5 1/4 09/15/38 MTN	0	5'580	0	5'580 AUD	96.73%	3'214'342.50	0.19	a)
CAQ57085HQ08	2.7230 % MQGAU 2.723 08/21/29 MPL	4'400	0	0	4'400 CAD	89.67%	2'633'851.06	0.16	a)
JP503622AH18	0.2930 % ANZ 0.293 01/23/24 10	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
US20271BAJ44	3.2140 % CBAAU 3.214 05/27/25 REGS	3'240	0	0	3'240 USD	97.52%	2'897'722.58	0.18	a)
US55608KAR68	1.3400 % MQGAU 1.34 01/12/27 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	92.60%	1'104'053.25	0.07	a)
US55608RBM16	5.2080 % MQGAU 5.208 06/15/26 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	99.31%	1'821'624.99	0.11	a)
US62878U2F87	5.7500 % NBNAU 5 3/4 10/06/28 144A	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US62878V2A72	1.4500 % NBNAU 1.45 05/05/26 REGS	1'800	0	0	1'800 USD	92.18%	1'521'738.95	0.09	a)
US62878V2D12	1.6250 % NBNAU 1 5/8 01/08/27 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	90.40%	829'085.26	0.05	a)
US63253QAG91	4.7870 % NAB 4.787 01/10/29	0	5'600	1'100	4'500 USD	97.83%	4'037'532.76	0.24	a)
US961214EL30	2.6500 % WSTP 2.65 01/16/30	0	1'050	0	1'050 USD	87.23%	840'050.70	0.05	a)
US961214EW94	1.9530 % WSTP 1.953 11/20/28	1'500	0	0	1'500 USD	86.62%	1'191'653.00	0.07	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.
USQ0426RND62	4.4000 % ANZ 4.4 05/19/26 REGS	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USQ66511AB43	5.7500 % NCMAU 5 3/4 11/15/41 REGS	2'510	1'500	4'010	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1602259985	3.5000 % CCEP 3 1/2 04/26/24 EMTN	0	1'000	1'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
XS2187427690	3.5000 % MQGAU 3 1/2 06/24/27 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	99.45%	3'772'543.68	0.23	a)
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	1'000	0	0	1'000 EUR	92.45%	906'607.82	0.05	a)
XS2463935754	3.6200 % NAB 3.62 04/01/25 GMTN	6'000	0	0	6'000 CNY	100.34%	761'306.80	0.05	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	102.09%	1'001'134.40	0.06	a)
XS2776519980	4.0000 % MELAIR 4 06/07/34 EMTN	0	4'700	4'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2778764188	3.9740 % TCLAU 3.974 03/12/36 EMTN	0	2'675	2'675	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2809670099	4.1250 % SYDAU 4 1/8 04/30/36 EMTN	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>AU</b>							<b>38'496'333.09</b>	<b>2.33</b>	
BE0312792642	0.0000 % BGBT 0 01/11/24 364D	0	10'000	10'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6350897169	4.8750 % BELG 4 7/8 06/10/55 REGS	0	15'000	3'000	12'000 USD	95.65%	10'527'377.87	0.64	a)
BE6351290216	3.8750 % LONNVX 3 7/8 04/24/36 EMTN	0	4'400	900	3'500 EUR	98.45%	3'379'101.96	0.20	a)
<b>BE</b>							<b>13'906'479.83</b>	<b>0.84</b>	
XS2341197536	2.0000 % COMQAT 2 05/12/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	92.70%	850'170.54	0.05	a)
XS2654057970	5.3750 % COMQAT 5 3/8 03/28/29 EMTN	0	7'500	2'500	5'000 USD	98.43%	4'513'937.16	0.27	a)
<b>BM</b>							<b>5'364'107.70</b>	<b>0.32</b>	
CA11070TAG37	2.8000 % BRCOL 2.8 06/18/48	1'500	0	0	1'500 CAD	72.30%	724'016.78	0.04	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	1'050	0	0	1'050 CAD	81.67%	572'484.25	0.03	a)
CA135087G997	0.5000 % CANRRB 0 1/2 12/01/50 CPI	1'500	0	0	1'500 CAD	88.36%	884'854.15	0.05	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	3'000	0	0	3'000 CAD	70.66%	1'415'188.79	0.09	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	3'000	0	0	3'000 CAD	97.22%	1'947'033.65	0.12	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	0	2'400	0	2'400 CAD	80.98%	1'297'400.25	0.08	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	2'500	0	0	2'500 CAD	65.37%	1'090'953.55	0.07	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	2'000	3'000	0	5'000 CAD	87.45%	2'918'944.95	0.18	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	1'500	0	0	1'500 CAD	92.62%	927'474.07	0.06	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	0	3'000	0	3'000 CAD	99.06%	1'983'923.93	0.12	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	2'000	0	2'000 CAD	95.47%	1'274'683.96	0.08	a)
CA135087VS05	4.2500 % CANRRB 4 1/4 12/01/26 CPI	1'600	0	0	1'600 CAD	191.19%	2'042'155.29	0.12	a)
CA135087VV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	2'000	0	0	2'000 CAD	198.56%	2'651'111.58	0.16	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	1'500	0	0	1'500 CAD	102.97%	1'031'055.25	0.06	a)
CA13509PHQ96	1.1000 % CANHOU 1.1 03/15/31	0	1'000	0	1'000 CAD	82.09%	548'040.27	0.03	a)
CA563469UF02	2.8500 % MP 2.85 09/05/46	0	1'000	0	1'000 CAD	72.78%	485'835.49	0.03	a)
CA563469UZ65	3.8000 % MP 3.8 09/05/53	3'800	1'200	0	5'000 CAD	84.45%	2'818'908.61	0.17	a)
CA642866GK79	2.6000 % NBRNS 2.6 08/14/26	700	0	0	700 CAD	95.95%	448'377.77	0.03	a)
CA683234ZP62	4.6000 % ONT 4.6 06/02/39	0	2'700	0	2'700 CAD	99.12%	1'786'558.94	0.11	a)
CA68323AAY07	3.5000 % ONT 3 1/2 06/02/43	2'000	0	0	2'000 CAD	84.78%	1'131'902.69	0.07	a)
CA68333ZAJ62	1.8500 % ONT 1.85 02/01/27	0	3'500	0	3'500 CAD	93.57%	2'186'349.82	0.13	a)
CA68333ZAR88	1.5500 % ONT 1.55 11/01/29	1'000	0	0	1'000 CAD	86.95%	580'431.08	0.04	a)
CA748148SA23	1.8500 % Q 1.85 02/13/27 QY	0	1'000	0	1'000 CAD	93.57%	624'624.65	0.04	a)
CA748148ZEW91	3.5000 % Q 3 1/2 12/01/48	0	2'000	0	2'000 CAD	82.20%	1'097'549.21	0.07	a)
CA780086SY14	1.6700 % RY 1.67 01/28/33	0	1'000	0	1'000 CAD	88.55%	591'159.04	0.04	a)
CAC75089AB59	4.1500 % PSPCAP 4.15 06/01/33	5'000	0	0	5'000 CAD	97.12%	3'241'885.10	0.20	a)
US06367TQW35	0.6250 % BMO 0 5/8 07/09/24 MTN	0	6'945	0	6'945 USD	99.05%	6'308'840.70	0.38	a)
US06367WB850	1.8500 % BMO 1.85 05/01/25 MTN	0	1'650	0	1'650 USD	96.39%	1'458'606.93	0.09	a)
US06368LAP13	4.2500 % BMO 4 1/4 09/14/24 H	2'500	0	0	2'500 USD	99.43%	2'279'805.61	0.14	a)
US0641596E11	0.6500 % BNS 0.65 07/31/24	0	9'000	0	9'000 USD	98.76%	8'151'913.52	0.49	a)
US064159MK98	3.4000 % BNS 3.4 02/11/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US125094AQ51	3.1500 % CADEPO 3.15 07/24/24 144A	1'150	0	0	1'150 USD	99.45%	1'048'921.53	0.06	a)
US12591DAC56	4.2500 % CNOOC 4 1/4 04/30/24	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US135087N757	2.8750 % CANADA 2 7/8 04/28/25	3'000	0	0	3'000 USD	97.65%	2'686'790.93	0.16	a)
US135087Q560	3.7500 % CANADA 3 3/4 04/26/28	4'900	0	0	4'900 USD	95.99%	4'314'003.96	0.26	a)
US13607GAP90	3.1000 % CM 3.1 04/02/24	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US13607GRR73	0.9500 % CM 0.95 10/23/25	0	1'600	0	1'600 USD	93.58%	1'373'215.68	0.08	a)
US22411WAW64	3.2500 % CPPIBC 3 1/4 06/15/27 REGS	0	7'000	0	7'000 USD	94.79%	6'085'822.20	0.37	a)
US29250NBR52	5.7000 % ENBCN 5.7 03/08/33	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29250NBZ78	6.7000 % ENBCN 6.7 11/15/53	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US30216BJU70	3.3750 % EDC 3 3/8 08/26/25	0	1'150	0	1'150 USD	97.53%	1'028'691.95	0.06	a)
US30216BKC53	4.1250 % EDC 4 1/8 02/13/29	0	10'600	4'600	6'000 USD	96.98%	5'336'932.54	0.32	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.
US31429LAL53	5.2500 % CCDJ 5 1/4 04/26/29 REGS	0	1'600	0	1'600 USD	98.23%	1'441'436.96	0.09	a)
US43358BAA17	4.6250 % CANADA 4 5/8 04/30/29	0	7'120	0	7'120 USD	99.21%	6'478'454.85	0.39	a)
US63307A2X29	5.6000 % NACN 5.6 12/18/28	0	3'750	650	3'100 USD	99.81%	2'837'876.71	0.17	a)
US69376Q2A05	0.5000 % PSPCAP 0 1/2 09/15/24 REGS	4'000	0	0	4'000 USD	98.17%	3'601'537.99	0.22	a)
US69376Q2B87	1.6250 % PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS	2'000	2'000	0	4'000 USD	86.56%	3'175'540.16	0.19	a)
US78013XZU52	2.5500 % RY 2.55 07/16/24 GMTN	0	5'700	0	5'700 USD	99.36%	5'194'454.20	0.31	a)
US78016FZX58	5.0000 % RY 5 02/01/33 GMTN	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US78016HZV58	4.9500 % RY 4.95 02/01/29 GMTN	0	2'425	0	2'425 USD	98.20%	2'184'099.63	0.13	a)
US89114QCA40	2.6500 % TD 2.65 06/12/24 MTN	0	3'000	0	3'000 USD	99.64%	2'741'572.29	0.17	a)
US89114TZD70	1.2000 % TD 1.2 06/03/26 MTN	0	1'550	0	1'550 USD	91.58%	1'301'927.90	0.08	a)
US89114TZG02	1.2500 % TD 1 1/4 09/10/26 MTN	2'000	0	0	2'000 USD	90.70%	1'663'746.79	0.10	a)
USC23264AL58	1.0000 % CADEPO 1 05/26/26 REGS	2'500	2'100	0	4'600 USD	91.77%	3'871'801.92	0.23	a)
USC23264A502	4.5000 % CADEPO 4 1/2 02/13/26 REGS	4'400	0	0	4'400 USD	98.60%	3'979'044.27	0.24	a)
USC24285JP17	1.1500 % CM 1.15 07/08/26 REGS	2'600	0	0	2'600 USD	91.32%	2'177'536.05	0.13	a)
USC68012AJ94	5.5000 % OMERFT 5 1/2 11/15/33 REGS	0	4'500	1'500	3'000 USD	101.35%	2'788'704.63	0.17	a)
USC69798AY93	4.6250 % ONTTFT 4 5/8 04/10/29 REGS	0	6'290	0	6'290 USD	97.98%	5'652'342.26	0.34	a)
XS2027438899	0.7500 % CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN	950	0	0	950 EUR	56.57%	527'006.99	0.03	a)
XS2056446524	1.6250 % CM 1 5/8 09/25/25 EMTN	0	500	0	500 GBP	94.96%	545'264.77	0.03	a)
XS2063349323	0.4780 % BRCOL 0.478 10/18/49 EMTN	0	6'500	0	6'500 EUR	46.85%	2'986'187.57	0.18	a)
XS2106828721	0.0000 % EDC 0 01/27/25 EMTN	1'535	0	0	1'535 EUR	97.38%	1'465'810.38	0.09	a)
XS2356317177	1.5000 % CPPIBC 1 1/2 06/23/28	0	1'450	0	1'450 AUD	87.75%	757'747.38	0.05	a)
XS2403528776	1.6250 % CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN	5'500	0	2'500	3'000 GBP	39.09%	1'346'774.12	0.08	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	53.68%	526'451.93	0.03	a)
XS2539371653	3.3000 % ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS	2'000	0	0	2'000 EUR	99.67%	1'954'941.77	0.12	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	3'400	700	500	3'600 EUR	99.34%	3'506'962.41	0.21	a)
XS2804565435	3.5000 % BNS 3 1/2 04/17/29 EMTN	0	13'100	3'100	10'000 EUR	99.24%	9'732'245.91	0.59	a)
XS2806614223	3.7500 % NACN 3 3/4 05/02/29 EMTN	0	7'500	0	7'500 EUR	99.55%	7'322'058.51	0.44	a)
<b>CA</b>							<b>156'137'977.02</b>	<b>9.45</b>	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	99.41%	2'047'334.41	0.12	a)
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	1'450	1'100	0	2'550 EUR	88.13%	2'203'969.62	0.13	a)
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	0	3'000	0	3'000 EUR	74.88%	2'203'089.96	0.13	a)
CH1111393000	0.0000 % ZKB 0 05/15/26 151	2'000	0	0	2'000 EUR	92.92%	1'822'473.15	0.11	a)
CH1170565753	2.0200 % ZKB 2.02 04/13/28	2'900	0	0	2'900 EUR	94.43%	2'685'444.20	0.16	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	2'400	0	500	1'900 EUR	97.39%	1'814'563.08	0.11	a)
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	102.93%	1'816'957.87	0.11	a)
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	3'200	700	2'500 EUR	99.96%	2'450'615.43	0.15	a)
CH1331113469	3.3040 % UBS 3.304 03/05/29	0	2'450	0	2'450 EUR	99.98%	2'402'179.76	0.15	a)
US22546QAP28	3.6250 % UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	6'666	500	0	7'166 USD	99.19%	6'518'929.85	0.39	a)
US22550L2J94	4.7500 % UBS 4 3/4 08/09/24	2'000	0	0	2'000 USD	99.69%	1'828'576.98	0.11	a)
US90352JAC71	4.2530 % UBS 4.253 03/23/28 144A	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH3698DAR55	4.2820 % UBS 4.282 01/09/28 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USH42097CC91	2.0950 % UBS 2.095 02/11/32 REGS	0	1'600	0	1'600 USD	78.04%	1'145'234.20	0.07	a)
USH42097DT18	5.9590 % UBS 5.959 01/12/34 REGS	2'300	0	0	2'300 USD	99.13%	2'091'008.45	0.13	a)
<b>CH</b>							<b>31'030'376.96</b>	<b>1.88</b>	
US05890PAB22	2.8750 % BCICI 2 7/8 10/14/31 REGS	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	0	2'225	0	2'225 USD	97.34%	1'986'275.19	0.12	a)
USP58072AY87	6.1250 % CMPCCI 6 1/8 02/26/34 REGS	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP8718AAP14	6.5000 % SQM 6 1/2 11/07/33 REGS	0	7'500	2'300	5'200 USD	100.16%	4'776'906.07	0.29	a)
XS1346652891	1.7500 % CHILE 1 3/4 01/20/26	3'500	0	0	3'500 EUR	96.49%	3'311'896.79	0.20	a)
XS1429577361	0.4800 % BANCO 0.48 06/17/26 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	98.94%	576'639.14	0.03	a)
XS2291692890	1.2500 % CHILE 1 1/4 01/22/51	2'000	0	0	2'000 EUR	54.52%	1'069'320.23	0.06	a)
XS2637387056	0.7500 % BNCHIL 0 3/4 06/16/25 EMTN	800'000	0	0	800'000 JPY	99.89%	4'657'174.08	0.28	a)
XS2645248225	4.1250 % CHILE 4 1/8 07/05/34	3'600	0	0	3'600 EUR	100.77%	3'557'623.71	0.22	a)
<b>CL</b>							<b>19'935'835.21</b>	<b>1.21</b>	
CND100009CN7	3.8000 % SDBC 3.8 01/25/36 1605	15'000	0	0	15'000 CNY	113.02%	2'143'721.79	0.13	a)
CND10001YC12	3.2800 % EXIMCH 3.28 02/11/24 1905	7'000	0	7'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
CND1000291L3	3.2900 % CGB 3.29 05/23/29 1906	10'000	0	0	10'000 CNY	105.92%	1'339'341.65	0.08	a)
CND10002D1Y9	3.8600 % CGB 3.86 07/22/49 1910	25'000	0	0	25'000 CNY	122.66%	3'877'618.97	0.23	a)
CND10002GGR3	3.4500 % SDBC 3.45 09/20/29 1915	12'000	0	0	12'000 CNY	105.67%	1'603'431.59	0.10	a)
CND10002M200	3.3900 % CGB 3.39 03/16/50 INBK	30'000	38'000	0	68'000 CNY	114.02%	9'804'192.80	0.59	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.
CND100036Q75	2.6800 % CGB 2.68 05/21/30 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	102.08%	3'872'503.98	0.23	a)
CND100037XX3	2.8500 % CGB 2.85 06/04/27 INBK	20'000	0	0	20'000 CNY	102.44%	2'590'672.70	0.16	a)
CND100035346	3.7900 % ADBCH 3.79 10/26/30 2010	10'000	0	0	10'000 CNY	108.41%	1'370'891.42	0.08	a)
CND100045GW3	3.7600 % CGB 3.76 03/22/2071 INBK	20'000	40'000	0	60'000 CNY	128.16%	9'723'804.73	0.59	a)
CND100047QT4	3.0200 % CGB 3.02 05/27/31 INBK	30'000	0	0	30'000 CNY	104.81%	3'975'992.30	0.24	a)
CND10007C5P4	2.3700 % CGB 2.37 01/15/29 INBK	0	13'000	0	13'000 CNY	100.95%	1'659'427.07	0.10	a)
XS2332559637	3.0800 % BCHINA 3.08 04/28/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	100.15%	2'532'909.43	0.15	a)
XS2800342318	3.3750 % SDBC 3 3/8 04/16/27 EMTN	0	5'750	2'750	3'000 EUR	99.69%	2'933'001.05	0.18	a)
<b>CN</b>							<b>47'427'509.48</b>	<b>2.87</b>	
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	87.29%	2'567'986.66	0.16	a)
CZ0001002059	4.8500 % CZGB 4.85 11/26/57 53	35'000	0	0	35'000 CZK	105.28%	1'435'394.31	0.09	a)
CZ0001005243	2.0000 % CZGB 2 10/13/33 103	10'000	0	0	10'000 CZK	82.31%	320'633.75	0.02	a)
CZ0001005375	2.7500 % CZGB 2 3/4 07/23/29 105	0	25'000	0	25'000 CZK	92.96%	905'257.75	0.05	a)
CZ0001005920	1.5000 % CZGB 1 1/2 04/24/40 125	15'000	0	0	15'000 CZK	67.06%	391'833.97	0.02	a)
XS2638560156	5.9430 % CESSPO 5.943 06/29/27 EMTN	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	900	0	900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>CZ</b>							<b>5'621'106.44</b>	<b>0.34</b>	
AU3CB0247401	3.5000 % DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	0	900	0	900 AUD	99.42%	532'908.88	0.03	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	5'200	2'800	0	8'000 EUR	50.24%	3'941'500.26	0.24	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	4'000	4'000	2'000	6'000 EUR	99.26%	5'840'465.51	0.35	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	3'000	0	500	2'500 EUR	97.18%	2'382'508.05	0.14	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	0	5'000	0	5'000 EUR	87.52%	4'291'500.62	0.26	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	2'000	5'000	0	7'000 EUR	75.14%	5'158'322.75	0.31	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	2'000	0	0	2'000 EUR	88.99%	1'745'412.27	0.11	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	4'500	0	1'500	3'000 EUR	47.61%	1'400'687.90	0.08	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'000	7'000	0	9'000 EUR	93.80%	8'279'062.85	0.50	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	0	2'500	0	2'500 EUR	107.08%	2'625'296.89	0.16	a)
DE000A2TSTE8	0.7500 % SAPGR 0 3/4 12/10/24	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	2'000	0	0	2'000 EUR	102.72%	2'014'625.21	0.12	a)
DE000A3823H4	4.8510 % ALVGR 4.851 07/26/54	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	6'500	0	6'500 EUR	99.28%	6'328'318.35	0.38	a)
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	7'000	0	1'000	6'000 EUR	55.19%	3'247'324.71	0.20	a)
DE000A3TOX22	0.2500 % PBBGR 0 1/4 10/27/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU0E071	0.0000 % BUBILL 0 07/17/24 364D	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	2'000	8'000	0	10'000 EUR	98.03%	9'612'996.70	0.58	a)
DE000LB2ZTL3	2.0000 % LBBW 2 02/24/25 EMTN	3'000	0	0	3'000 USD	97.02%	2'669'401.76	0.16	a)
US251526CE71	2.1290 % DB 2.129 11/24/26	2'000	0	0	2'000 USD	94.10%	1'726'112.99	0.10	a)
US251526CG20	1.4470 % DB 1.447 04/01/25	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769BN36	2.0500 % KFW 2.05 02/16/26	100'000	300'000	100'000	300'000 JPY	103.16%	1'803'702.05	0.11	a)
US500769BR40	0.0000 % KFW 0 04/18/36	1'000	2'000	0	3'000 USD	55.68%	1'532'034.87	0.09	a)
US500769HX53	2.6250 % KFW 2 5/8 02/28/24	2'150	0	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US500769JL97	0.7500 % KFW 0 3/4 02/19/26	2'000	500	0	2'500 CAD	93.40%	1'558'857.93	0.09	a)
US500769JV79	3.3750 % KFW 3 3/8 08/23/24	0	13'000	0	13'000 USD	99.35%	11'845'808.51	0.72	a)
US500769KD52	4.3750 % KFW 4 3/8 02/28/34	0	9'100	0	9'100 USD	96.57%	8'059'878.43	0.49	a)
US515110BN30	2.0000 % RENTEN 2 01/13/25	0	1'000	0	1'000 USD	97.66%	895'716.20	0.05	a)
US515110BR44	1.7500 % RENTEN 1 3/4 07/27/26 GMTN	1'300	0	0	1'300 USD	92.99%	1'108'667.43	0.07	a)
US515110BT00	2.5000 % RENTEN 2 1/2 11/15/27 37	1'200	0	0	1'200 USD	92.12%	1'013'887.31	0.06	a)
US515110CA00	0.8750 % RENTEN 0 7/8 03/30/26	0	2'350	0	2'350 USD	92.29%	1'989'193.34	0.12	a)
XS0460070930	5.5800 % DB 5.58 09/01/26 EMTN	4'000	0	0	4'000 USD	97.40%	3'573'106.34	0.22	a)
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 USD	96.93%	888'984.32	0.05	a)
XS1388661735	1.2500 % DHLGR 1 1/4 04/01/26 EMTN	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1721762240	7.4600 % RENTEN 7.46 11/22/27 EMTN	0	40'000	0	40'000 MXN	87.84%	1'891'347.18	0.11	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2233088132	0.1250 % HHOCGR 0 1/8 02/24/31	1'400	0	0	1'400 EUR	80.55%	1'105'912.88	0.07	a)
XS2322827382	2.7000 % KFW 2.7 03/25/24 EMTN	16'000	0	16'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2331271242	0.6250 % DBHNGR 0 5/8 04/15/36 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	72.23%	1'062'504.59	0.06	a)
XS2338980746	0.3750 % FMSWER 0 3/8 05/06/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 USD	100.00%	1'834'300.00	0.11	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.
X52357951164	1.1250 % DBHNGR 1 1/8 05/29/51 EMTN	2'692	0	0	2'692 EUR	58.24%	1'537'511.47	0.09	a)
X52388457264	0.0000 % KFW 0 09/15/31 EMTN	2'300	0	0	2'300 EUR	80.90%	1'824'661.02	0.11	a)
X52422922943	1.0000 % BYLAN 1 12/20/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
X52451378181	2.7500 % KFW 2 3/4 03/03/25 EMTN	30'000	40'000	0	70'000 CNY	99.86%	8'839'336.22	0.53	a)
X52577042893	3.6250 % DBHNGR 3 5/8 12/18/37 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52590582529	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 EMTN	7'000	55'000	0	62'000 CNY	100.31%	7'864'171.27	0.48	a)
X52624017070	3.2500 % DBHNGR 3 1/4 05/19/33 EMTN	0	4'100	1'600	2'500 EUR	100.52%	2'464'467.37	0.15	a)
X52629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	2'700	0	2'700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	1'100	0	0	1'100 EUR	102.25%	1'103'027.75	0.07	a)
X52712037055	2.9000 % KFW 2.9 02/24/26 NOV	0	55'000	55'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52722190795	4.0000 % DBHNGR 4 11/23/43 EMTN	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52745726047	4.0000 % VW 4 04/11/31 EMTN	0	2'925	2'925	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	1'900	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52756954835	4.1250 % KFW 4 1/8 01/31/28 EMTN	0	15'000	3'000	12'000 USD	97.25%	10'703'250.56	0.65	a)
X52760775549	4.1250 % RENTEN 4 1/8 02/06/31 EMTN	0	3'500	0	3'500 USD	95.61%	3'069'233.30	0.19	a)
X52808428853	2.7500 % KFW 2 3/4 04/26/27 EMTN	0	20'000	0	20'000 CNY	100.01%	2'529'368.78	0.15	a)
<b>DE</b>							<b>141'895'374.82</b>	<b>8.59</b>	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	5'000	0	0	5'000 DKK	121.82%	800'884.87	0.05	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	3'000	0	0	3'000 DKK	92.83%	366'163.13	0.02	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	6'000	0	0	6'000 DKK	82.89%	653'932.60	0.04	a)
US23636ABD28	3.7730 % DANBNK 3.773 03/28/25 144A	1'400	0	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52291068992	0.5000 % KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN	2'500	2'200	0	4'700 USD	92.16%	3'972'653.57	0.24	a)
<b>DK</b>							<b>5'793'634.17</b>	<b>0.35</b>	
E50000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	0	1'500	1'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
E50000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	1'300	150	0	1'450 EUR	64.44%	916'273.78	0.06	a)
E50000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	1'000	0	0	1'000 EUR	66.52%	652'369.68	0.04	a)
E50344251022	4.3750 % CAZAR 4 3/8 07/30/28	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP572405AKC8	0.4630 % SANTAN 0.463 12/05/24 1	100'000	0	0	100'000 JPY	99.74%	581'313.33	0.04	a)
US05946KAJ07	1.1250 % BBVASM 1 1/8 09/18/25	0	1'800	0	1'800 USD	93.74%	1'547'542.05	0.09	a)
US05946KAQ40	5.3810 % BBVASM 5.381 03/13/29	0	4'400	0	4'400 USD	98.92%	3'991'715.61	0.24	a)
US05964HAN52	1.7220 % SANTAN 1.722 09/14/27	1'400	0	0	1'400 USD	90.55%	1'162'645.37	0.07	a)
US05971KAK51	5.7420 % SANTAN 5.742 06/30/24	4'000	0	0	4'000 USD	99.96%	3'667'169.25	0.22	a)
XS1767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	0	4'000	0	4'000 EUR	93.57%	3'670'600.57	0.22	a)
XS2076079594	0.6250 % SABSOM 0 5/8 11/07/25	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	92.56%	1'815'451.57	0.11	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	0	1'100	0	1'100 EUR	87.73%	946'417.05	0.06	a)
XS2393518597	2.2500 % SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN	2'600	0	600	2'000 GBP	87.11%	2'000'666.93	0.12	a)
XS2645244745	0.7580 % SANSCF 0.758 07/07/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.59%	2'321'779.74	0.14	a)
XS2645245122	0.9130 % SANSCF 0.913 07/07/26 EMTN	500'000	0	0	500'000 JPY	99.15%	2'889'344.42	0.17	a)
XS2645245395	1.0650 % SANSCF 1.065 07/07/28 EMTN	200'000	0	0	200'000 JPY	97.88%	1'140'969.18	0.07	a)
XS2661068234	5.2500 % FCCSER 5 1/4 10/30/29	5'100	0	5'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2698998593	5.1250 % ANESM 5 1/8 04/23/31 EMTN	7'800	0	7'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>ES</b>							<b>27'304'258.53</b>	<b>1.65</b>	
US65559D2E87	1.5000 % NDAFH 1 1/2 09/30/26 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	90.67%	997'939.91	0.06	a)
XS1241947768	2.3750 % FINNVE 2 3/8 06/04/25 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	96.61%	1'063'215.31	0.06	a)
XS2242924491	0.0000 % KUNTA 0 10/14/30 EMTN	1'200	0	0	1'200 EUR	82.41%	969'849.13	0.06	a)
XS2584643113	3.6250 % NDAFH 3 5/8 02/10/26 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	99.71%	1'955'549.78	0.12	a)
XS2718201515	3.8750 % NESVFH 3 7/8 05/21/31 EMTN	0	2'100	2'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>FI</b>							<b>4'986'554.13</b>	<b>0.30</b>	
AU3C80306017	5.4110 % ACAFP 5.411 01/18/29 MTN	0	3'950	0	3'950 AUD	99.84%	2'348'546.33	0.14	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39 22Y	0	2'500	0	2'500 EUR	82.10%	2'012'820.78	0.12	a)
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	90.25%	2'655'069.97	0.16	a)
FR0013425451	1.7500 % BFCM 1 3/4 12/19/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 GBP	97.88%	2'248'126.18	0.14	a)
FR0013426905	0.4440 % BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN	100'000	0	0	100'000 JPY	94.73%	552'079.23	0.03	a)
FR0013464963	4.5000 % EDF 4 1/2 12/04/69 EMTN	0	6'000	0	6'000 USD	68.34%	3'760'626.83	0.23	a)
FR0013483914	1.0000 % SOGRPR 1 02/18/70 EMTN	2'000	0	0	2'000 EUR	41.12%	806'403.18	0.05	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40 19Y	0	6'000	0	6'000 EUR	65.30%	3'842'374.36	0.23	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.
FR0014000C08	0.8750 % SNCF 0 7/8 02/28/51	800	0	0	800 EUR	48.55%	380'860.02	0.02	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	0	1'700	0	1'700 EUR	81.52%	1'358'998.73	0.08	a)
FR0014002GB5	0.3750 % AGFRNC 0 3/8 05/25/36 EMTN	0	800	0	800 EUR	69.55%	545'604.37	0.03	a)
FR0014006O80	1.0000 % SOGRPR 1 11/26/51 EMTN	0	5'000	1'000	4'000 EUR	53.99%	2'117'654.18	0.13	a)
FR0014006TX3	0.7500 % VDP 0 3/4 11/30/41 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	62.42%	918'258.16	0.06	a)
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	1'800	1'000	0	2'800 EUR	91.16%	2'503'080.18	0.15	a)
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	0	3'000	0	3'000 EUR	68.94%	2'028'334.95	0.12	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38 16Y	2'500	0	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400AXN4	0.1740 % CDCEPS 0.174 06/16/27 EMTN	400'000	100'000	0	500'000 JPY	97.98%	2'855'133.06	0.17	a)
FR001400F0V4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	1'800	0	0	1'800 EUR	100.73%	1'778'017.52	0.11	a)
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	900	0	0	900 EUR	102.22%	902'203.64	0.05	a)
FR001400GGZ0	4.1250 % BFCM 4 1/8 03/13/29 EMTN	2'500	0	0	2'500 EUR	102.02%	2'501'291.44	0.15	a)
FR001400I7U8	6.0000 % BNP 6 08/18/29 EMTN	2'700	0	0	2'700 GBP	102.51%	3'178'657.03	0.19	a)
FR001400KWR6	6.0000 % ELOFR 6 03/22/29 EMTN	4'800	0	4'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFF 5 1/2 10/09/28 EMTN	3'900	0	3'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400LH44	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 10/19/26	300'000	0	0	300'000 JPY	99.85%	1'745'880.78	0.11	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400M2G2	5.7500 % RCFFP 5 3/4 11/22/31 EMTN	0	1'800	1'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400NC70	3.8750 % ALDFP 3 7/8 01/24/28	0	8'000	7'000	1'000 EUR	99.77%	978'431.94	0.06	a)
FR001400O457	3.8750 % ALDFP 3 7/8 02/22/27	0	5'400	5'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ORA4	4.8000 % AKEFP 4.8 PERP EMTN	0	2'300	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400P8C5	4.0000 % TISSEO 4 04/08/39 EMTN	0	10'400	1'400	9'000 EUR	97.77%	8'629'102.44	0.52	a)
FR001400PGC0	4.3750 % ACAFP 4 3/8 04/15/36	0	4'400	500	3'900 EUR	98.56%	3'769'683.33	0.23	a)
FR0127921064	0.0000 % BTF 0 04/17/24	0	7'000	7'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227685	0.0000 % BTF 0 04/04/24	0	4'200	4'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0128227701	0.0000 % BTF 0 04/10/24	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
JP525017AP97	1.0100 % BNP 1.01 09/07/28 8	1'000'000	0	0	1'000'000 JPY	99.55%	5'802'059.80	0.35	a)
JP525020BPA4	1.2030 % BFCM 1.203 10/16/28 42	300'000	0	0	300'000 JPY	100.41%	1'755'637.13	0.11	a)
JP525022ANC3	0.7630 % ACAFP 0.763 12/05/25 17	400'000	0	0	400'000 JPY	99.85%	2'327'864.35	0.14	a)
JP525022AQ16	0.7240 % ACAFP 0.724 01/26/27 22	0	600'000	0	600'000 JPY	99.71%	3'486'621.11	0.21	a)
JP525023BL76	0.0700 % CDCEPS 0.07 07/30/24 9	100'000	0	0	100'000 JPY	99.94%	582'473.14	0.04	a)
US05578BAV80	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/14/25 REGS	0	2'590	0	2'590 USD	97.09%	2'306'388.84	0.14	a)
US05578QAB95	5.1500 % BPCEGP 5.15 07/21/24 144A	2'000	0	0	2'000 USD	99.69%	1'828'558.64	0.11	a)
US06675GAY17	1.6040 % BFCM 1.604 10/04/26 REGS	2'500	0	0	2'500 USD	91.07%	2'088'006.62	0.13	a)
US09659X2K76	3.0520 % BNP 3.052 01/13/31 REGS	0	3'000	0	3'000 USD	86.10%	2'368'915.91	0.14	a)
US83368TAZ12	1.4880 % SOCGEN 1.488 12/14/26 REGS	2'200	0	0	2'200 USD	92.83%	1'873'099.11	0.11	a)
US83368TBG22	2.2260 % SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS	4'000	0	2'000	2'000 USD	97.11%	1'781'270.39	0.11	a)
US83368TBR86	6.4460 % SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	101.17%	1'855'761.31	0.11	a)
US83368TBY38	7.1320 % SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS	0	4'200	700	3'500 USD	95.51%	3'065'959.08	0.19	a)
USF2893TAQ97	4.9500 % EDF 4.95 10/13/45 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	3'500	0	3'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1490307516	2.5600 % ACAFP 2.56 12/20/23 EMTN	1'024	0	1'024	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	0	3'200	3'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>FR</b>							<b>85'539'854.06</b>	<b>5.18</b>	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	0	1'640	0	1'640 AUD	98.90%	965'960.47	0.06	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'500	0	0	1'500 GBP	101.63%	1'750'709.89	0.11	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	2'000	0	0	2'000 GBP	54.38%	1'249'101.90	0.08	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	500	1'400	0	1'900 GBP	56.50%	1'232'882.92	0.07	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	0	3'000	1'000	2'000 GBP	89.50%	2'055'652.77	0.12	a)
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	3'000	0	0	3'000 GBP	83.99%	2'893'612.64	0.18	a)
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	2'000	1'700	0	3'700 GBP	73.97%	3'142'900.16	0.19	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	2'900	2'240	0	5'140 GBP	48.90%	2'886'481.02	0.17	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	9'500	15'500	0	25'000 GBP	28.50%	8'181'555.45	0.50	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	3'000	0	3'000 GBP	75.43%	2'598'770.02	0.16	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	7'900	3'000	2'400	8'500 GBP	66.69%	6'509'833.16	0.39	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	0	1'500	0	1'500 GBP	47.81%	823'495.65	0.05	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	0	800	0	800 GBP	83.69%	768'892.23	0.05	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	7'600	0	0	7'600 GBP	72.36%	6'315'429.27	0.38	a)
JP582666CG91	1.2070 % HSBC 1.207 09/25/26 3	200'000	0	0	200'000 JPY	99.66%	1'161'705.81	0.07	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.
US046353AG32	4.0000 % AZN 4 09/18/42	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	0	2'000	0	2'000 USD	98.13%	1'800'035.28	0.11	a)
US63859VBF76	1.0000 % NWIDE 1 08/28/25 REGS	1'900	2'000	0	3'900 USD	94.19%	3'368'960.67	0.20	a)
US639057AC29	1.6420 % NWG 1.642 06/14/27	0	800	0	800 USD	91.61%	672'153.55	0.04	a)
US639057AK45	5.8080 % NWG 5.808 09/13/29	2'300	0	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG25839PT55	1.5000 % CCEP 1 1/2 01/15/27 REGS	0	600	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG6398ADD66	5.2640 % NWIDE 5.264 11/10/26 REGS	0	4'100	0	4'100 USD	99.81%	3'752'982.39	0.23	a)
USG84228GC69	6.0970 % STANLN 6.097 01/11/35 REGS	0	5'350	5'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	0	1'000	0	1'000 GBP	99.73%	1'145'251.24	0.07	a)
XS1472663670	3.2500 % BACR 3 1/4 02/12/27 EMTN	0	2'500	0	2'500 GBP	93.70%	2'690'034.11	0.16	a)
XS1527126772	1.1170 % BPLN 1.117 01/25/24 EMTN	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1699636574	2.2500 % LLOYDS 2 1/4 10/16/24 EMTN	1'000	0	0	1'000 GBP	98.54%	1'131'688.53	0.07	a)
XS1876165819	5.7193 % HSBC 3.3 09/28/24 EMTN	2'000	0	0	2'000 USD	99.48%	1'824'822.72	0.11	a)
XS2078692014	3.5160 % STANLN 3.516 02/12/30 EMTN	1'000	0	0	1'000 USD	97.36%	892'937.24	0.05	a)
XS2251641267	1.7000 % BACR 1.7 11/03/26	900	500	0	1'400 GBP	93.97%	1'510'872.63	0.09	a)
XS2287624154	1.5000 % MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN	0	1'500	0	1'500 GBP	57.49%	990'382.50	0.06	a)
XS2322315727	1.7500 % HSBC 1 3/4 07/24/27	0	500	0	500 GBP	91.73%	526'729.44	0.03	a)
XS2333299324	1.0000 % IFFIM 1 04/21/26 GMTN	0	2'000	0	2'000 USD	92.04%	1'688'234.69	0.10	a)
XS2351311290	0.6540 % BACR 0.654 06/09/27 EMTN	600'000	500'000	0	1'100'000 JPY	97.25%	6'234'684.86	0.38	a)
XS2403426427	2.9500 % PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2423041107	3.2600 % GS 3.26 07/08/24 EMTN	3'250	0	0	3'250 USD	99.35%	2'961'422.32	0.18	a)
XS2428496637	2.6080 % STANLN 2.608 01/12/28 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	91.62%	1'680'604.00	0.10	a)
XS2431784441	2.1250 % MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN	0	800	0	800 GBP	63.14%	580'075.35	0.04	a)
XS2593105393	3.6250 % AZN 3 5/8 03/03/27 EMTN	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	3'000	0	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2618731256	4.8740 % STANLN 4.874 05/10/31	2'500	0	0	2'500 EUR	103.90%	2'547'358.32	0.15	a)
XS2662538425	4.9180 % BACR 4.918 08/08/30 EMTN	3'200	0	700	2'500 EUR	103.62%	2'540'420.09	0.15	a)
XS2673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	1'900	2'200	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	2'000	0	700	1'300 EUR	103.88%	1'324'269.36	0.08	a)
XS2692259398	6.8750 % AVLN 6 7/8 11/27/53	0	2'400	2'400	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	3'600	1'600	2'000 EUR	99.92%	1'959'845.10	0.12	a)
XS2742661122	5.6250 % MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN	0	1'350	0	1'350 GBP	100.74%	1'561'825.26	0.09	a)
XS2745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	5'600	1'700	3'900 EUR	99.37%	3'800'662.63	0.23	a)
XS2754450612	5.4750 % GS 5.475 02/24/25 EMTN	0	7'000	0	7'000 USD	100.04%	6'422'810.62	0.39	a)
XS2758114321	3.2500 % CPGLN 3 1/4 02/06/31 EMTN	0	2'500	2'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2779881601	3.7500 % AALLN 3 3/4 06/15/29	0	4'100	4'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>GB</b>							<b>96'146'046.26</b>	<b>5.82</b>	
XS1138283236	4.0800 % CCB 4.08 11/18/24 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	100.46%	1'270'374.73	0.08	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	1'450	1'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>HK</b>							<b>1'270'374.73</b>	<b>0.08</b>	
AT0000A39UM6	4.8750 % ERSTEI 4 7/8 01/31/29 EMTN	0	2'300	2'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>HR</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
US78448TAK88	5.7000 % SMBCAC 5.7 07/25/33 144A	8'000	0	4'000	4'000 USD	97.44%	3'574'537.10	0.22	a)
XS2283177561	3.0000 % ZURNVX 3 04/19/51 EMTN	4'400	0	0	4'400 USD	81.00%	3'268'520.83	0.20	a)
XS2337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	0	2'100	0	2'100 EUR	91.60%	1'888'330.32	0.11	a)
XS2416978190	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2695009998	7.8750 % GLJGR 7 7/8 04/06/27 EMTN	4'000	0	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>IE</b>							<b>8'729'388.25</b>	<b>0.53</b>	
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	1'500	0	1'500	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	2'000	0	2'000	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
<b>IL</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2182399274	0.6250 % ICELND 0 5/8 06/03/26	2'040	0	2'040	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2293755125	0.0000 % ICELND 0 04/15/28	5'571	0	2'200	3'371 EUR	87.33%	2'887'081.70	0.17	a)
XS2411726438	0.7500 % LANBNN 0 3/4 05/25/26	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2671896418	7.1470 % LANBNN FLOAT 08/25/25 EMTN	30'000	0	0	30'000 SEK	101.87%	2'553'562.52	0.15	a)
XS2679765037	6.3750 % LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN	4'000	0	0	4'000 EUR	104.15%	4'085'579.98	0.25	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.
XS2779814750	5.0000 % LANBNN 5 05/13/28 EMTN	0	2'050	0	2'050 EUR	100.28%	2'016'038.35	0.12	a)
XS2788435050	3.5000 % ICELND 3 1/2 03/21/34	0	2'450	2'450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2792180197	4.6250 % ISLBAN 4 5/8 03/27/28	0	4'700	0	4'700 EUR	99.26%	4'575'215.68	0.28	a)
<b>IS</b>							<b>16'117'478.23</b>	<b>0.98</b>	
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	0	4'000	4'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	0	4'000	1'000	3'000 EUR	87.08%	2'561'808.46	0.16	a)
IT0005532723	2.0000 % BTPS 2 03/14/28 ICPI	3'900	0	900	3'000 EUR	99.56%	2'929'060.25	0.18	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	5'000	5'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005568123	4.7500 % CDEP 4 3/4 10/18/30 EMTN	6'000	0	4'000	2'000 EUR	104.09%	2'041'515.12	0.12	a)
IT0005570988	4.6000 % UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN	0	6'100	6'100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	7'400	7'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
US465410CA47	1.2500 % ITALY 1 1/4 02/17/26	0	2'500	1'000	1'500 USD	92.44%	1'271'733.95	0.08	a)
US465410CC03	3.8750 % ITALY 3 7/8 05/06/51	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2348710562	1.9820 % UCGIM 1.982 06/03/27 REGS	4'500	0	1'600	2'900 USD	92.09%	2'449'270.17	0.15	a)
XS2596085899	1.4640 % ISPIM 1.464 03/09/26 EMTN	500'000	200'000	0	700'000 JPY	99.85%	4'073'640.22	0.25	a)
XS2616750563	5.7500 % CDEP 5 3/4 05/05/26 REGS	3'200	0	1'200	2'000 USD	98.77%	1'811'738.11	0.11	a)
XS2638075700	6.6250 % ISPIM 6 5/8 06/20/33 REGS	2'500	0	800	1'700 USD	100.56%	1'567'870.68	0.09	a)
XS2673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	2'000	0	600	1'400 EUR	106.96%	1'468'505.01	0.09	a)
XS2739132897	3.8750 % ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN	0	2'800	2'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2767499945	3.8750 % SRGIM 3 7/8 02/19/34 EMTN	0	6'900	6'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2770512064	4.7500 % ENELIM 4 3/4 PERP	0	6'650	6'650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>IT</b>							<b>20'175'141.97</b>	<b>1.22</b>	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	400'000	0	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	0	400'000	0	400'000 JPY	99.43%	2'318'026.40	0.14	a)
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	0	500'000	0	500'000 JPY	96.67%	2'817'162.53	0.17	a)
JP1103661N43	0.2000 % JGB 0.2 03/20/32 366	0	200'000	200'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103681NA2	0.2000 % JGB 0.2 09/20/32 368	0	300'000	0	300'000 JPY	95.57%	1'670'977.14	0.10	a)
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	97.74%	5'696'161.95	0.34	a)
JP1120201F51	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/25 20	500'000	0	0	500'000 JPY	110.37%	3'216'279.99	0.19	a)
JP1120241K56	0.1000 % JGBI 0.1 03/10/29 24	500'000	0	0	500'000 JPY	112.87%	3'289'188.61	0.20	a)
JP1120261M59	0.0050 % JGBI 0.005 03/10/31 26	200'000	0	0	200'000 JPY	114.43%	1'333'849.56	0.08	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	200'000	200'000	400'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	750'000	850'000	0	1'600'000 JPY	105.86%	9'871'427.97	0.60	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	500'000	500'000	0	1'000'000 JPY	102.43%	5'969'969.38	0.36	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	0	500'000	0	500'000 JPY	103.32%	3'010'861.76	0.18	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	1'000'000	300'000	760'000	540'000 JPY	110.62%	3'481'508.64	0.21	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	500'000	0	0	500'000 JPY	108.18%	3'152'369.73	0.19	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	400'000	0	0	400'000 JPY	105.47%	2'458'671.80	0.15	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	300'000	0	0	300'000 JPY	103.50%	1'809'646.79	0.11	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	600'000	0	0	600'000 JPY	73.98%	2'586'833.25	0.16	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	400'000	0	0	400'000 JPY	78.16%	1'822'165.69	0.11	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	200'000	320'000	0	520'000 JPY	75.37%	2'284'108.78	0.14	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	95.18%	5'547'310.49	0.34	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	0	1'100'000	0	1'100'000 JPY	87.93%	5'637'052.65	0.34	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	700'000	300'000	0	1'000'000 JPY	63.62%	3'708'114.88	0.22	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	300'000	0	0	300'000 JPY	74.78%	1'307'509.14	0.08	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	500'000	100'000	0	600'000 JPY	62.11%	2'171'925.83	0.13	a)
JP316572BLC2	0.1800 % NTT 0.18 12/19/25 16	200'000	0	0	200'000 JPY	99.60%	1'160'913.18	0.07	a)
JP316572DLC8	0.3800 % NTT 0.38 09/20/30 18	100'000	0	0	100'000 JPY	96.55%	562'727.30	0.03	a)
US60687YCP25	5.6670 % MIZUHO 5.667 05/27/29	3'500	0	1'200	2'300 USD	99.94%	2'108'158.24	0.13	a)
US86562MAA80	4.4360 % SUMIBK 4.436 04/02/24 144A	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US86562MBM10	2.6960 % SUMIBK 2.696 07/16/24	0	5'000	0	5'000 USD	99.37%	4'556'859.78	0.28	a)
US86562MBV19	2.3480 % SUMIBK 2.348 01/15/25	0	2'188	0	2'188 USD	97.67%	1'960'027.73	0.12	a)
US86562MCA62	1.4740 % SUMIBK 1.474 07/08/25	0	650	0	650 USD	95.19%	567'466.84	0.03	a)
US86562MCT53	5.4640 % SUMIBK 5.464 01/13/26	3'600	0	0	3'600 USD	99.75%	3'293'353.58	0.20	a)
US874060AX48	2.0500 % TACHEM 2.05 03/31/30	0	2'350	550	1'800 USD	82.65%	1'364'477.07	0.08	a)
USJ5539RAC82	1.1620 % NTT 1.162 04/03/26 REGS	1'350	1'350	0	2'700 USD	92.13%	2'281'345.51	0.14	a)
USJ7771YSX69	5.2000 % SUMITR 5.2 03/07/29 REGS	0	3'600	0	3'600 USD	98.59%	3'255'284.52	0.20	a)
XS0257403278	2.3000 % DBJJP 2.3 03/19/26 INTL	340'000	170'000	240'000	270'000 JPY	103.42%	1'627'470.43	0.10	a)
XS0432572344	2.8500 % JAPEXP 2.85 03/18/39 1	230'000	0	0	230'000 JPY	113.68%	1'523'843.24	0.09	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.
X52059791231	2.2000 % CJRAIL 2.2 10/02/24	2'500	0	0	2'500 USD	98.39%	2'255'959.71	0.14	a)
X52613192926	4.1250 % JFM 4 1/8 04/27/28 REGS	7'000	0	2'000	5'000 USD	96.13%	4'408'052.19	0.27	a)
X52673437484	4.3890 % EJRAIL 4.389 09/05/43 EMTN	3'800	0	800	3'000 EUR	103.95%	3'058'330.40	0.19	a)
X52698464885	4.0860 % SUMITR 4.086 04/19/28 EMTN	6'000	0	0	6'000 EUR	101.52%	5'973'267.55	0.36	a)
X52799473637	3.3840 % ASABRE 3.384 04/16/29	0	3'300	0	3'300 EUR	98.97%	3'202'806.31	0.19	a)
<b>JP</b>							<b>118'321'466.54</b>	<b>7.16</b>	
JP541037AP66	0.7600 % KOREAN 0.76 06/29/26 3	300'000	0	300'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
KR10350172C8	3.0000 % KTB 3 12/10/42 4212	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	92.05%	1'832'465.27	0.11	a)
KR103501GA35	1.5000 % KTB 1 1/2 03/10/25 2503	3'000'000	0	0	3'000'000 KRW	98.35%	1'957'924.68	0.12	a)
KR103502G3C1	3.7500 % KTB 3 3/4 12/10/33 3312	8'000'000	0	0	8'000'000 KRW	100.76%	5'348'964.45	0.32	a)
KR103502GD64	3.2500 % KTB 3 1/4 06/10/33 3306	0	3'000'000	0	3'000'000 KRW	96.77%	1'926'469.54	0.12	a)
KR103503GB99	1.8750 % KTB 1 7/8 09/10/41 4109	0	6'000'000	0	6'000'000 KRW	78.31%	3'117'949.92	0.19	a)
US50066RAS58	2.1250 % KOROIL 2 1/8 04/18/27 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY3815NBC49	1.2500 % HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS	1'300	0	0	1'300 USD	92.27%	1'100'094.83	0.07	a)
USY3815NBG52	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS	0	2'200	0	2'200 USD	98.19%	1'981'269.62	0.12	a)
USY3815NBH36	5.1250 % HYUCAP 5 1/8 02/05/29 REGS	0	1'400	0	1'400 USD	96.98%	1'245'284.26	0.08	a)
USY4938AAJ89	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/27 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	98.44%	902'824.12	0.05	a)
USY4938AAL36	4.8750 % KOROIL 4 7/8 04/03/29 REGS	0	400	0	400 USD	97.64%	358'213.11	0.02	a)
X52322585196	2.8500 % EIBKOR 2.85 03/25/24 EMTN	14'000	0	14'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52369288886	3.2000 % HYUCAP 3.2 08/11/24 GMTN	17'000	0	0	17'000 CNY	99.85%	2'146'416.48	0.13	a)
X52427995001	2.5000 % SHINCA 2 1/2 01/27/27	2'200	0	0	2'200 USD	91.50%	1'846'222.95	0.11	a)
X52690013052	5.7500 % KOLAHO 5 3/4 10/06/25	6'000	0	3'000	3'000 USD	100.02%	2'751'917.75	0.17	a)
X52740452649	3.3200 % SHNHAN 3.32 01/29/27	0	1'700	500	1'200 EUR	99.11%	1'166'327.90	0.07	a)
X52775400703	5.5000 % SHINCA 5 1/2 03/12/29	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>KR</b>							<b>27'682'344.88</b>	<b>1.68</b>	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	1'500	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X51986376371	8.1600 % ADCBUH 8.16 04/29/29 EMTN	0	30'000'000	0	30'000'000 IDR	99.49%	1'683'584.66	0.10	a)
X52181280848	3.6000 % QNBK 3.6 06/05/25 EMTN	20'000	12'000	0	32'000 CNY	99.82%	4'038'978.04	0.24	a)
X52196300698	3.8500 % QNBK 3.85 07/10/25 EMTN	0	10'000	0	10'000 CNY	100.49%	1'270'665.57	0.08	a)
X52223675146	3.5000 % QNBK 3 1/2 03/09/26 EMTN	0	5'000	0	5'000 CNY	99.51%	629'149.28	0.04	a)
X52227817876	3.8000 % QNBK 3.8 09/15/25 EMTN	13'120	0	0	13'120 CNY	100.31%	1'664'193.30	0.10	a)
X52299092747	3.2800 % QNBK 3.28 02/18/24 EMTN	8'000	0	8'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52336361428	3.4200 % QNBK 3.42 04/27/24 EMTN	10'000	5'000	15'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52454678009	4.0000 % QNBK 4 03/14/27 EMTN	10'000	0	0	10'000 CNY	100.60%	1'272'107.12	0.08	a)
<b>KY</b>							<b>10'558'677.97</b>	<b>0.64</b>	
X52765498717	3.5000 % LITHUN 3 1/2 02/13/34 EMTN	0	8'050	4'550	3'500 EUR	98.04%	3'365'063.69	0.20	a)
<b>LT</b>							<b>3'365'063.69</b>	<b>0.20</b>	
DE000A3LWGF9	3.7500 % TRAGR 3 3/4 03/27/30 EMTN	0	5'000	2'000	3'000 EUR	98.76%	2'905'581.58	0.18	a)
LU2591861021	3.2500 % LGB 3 1/4 03/02/43	1'900	0	1'900	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
LU2773894873	2.8750 % LGB 2 7/8 03/01/34	0	1'200	0	1'200 EUR	98.80%	1'162'726.89	0.07	a)
X51761721262	1.6250 % ARNDTN 1 5/8 01/31/28 EMTN	2'800	0	500	2'300 EUR	84.97%	1'916'574.12	0.12	a)
X51964701822	5.3750 % ARNDTN 5 3/8 03/21/29 EMTN	900	0	0	900 USD	86.11%	710'790.33	0.04	a)
X52286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	1'700	0	0	1'700 EUR	77.89%	1'298'515.06	0.08	a)
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	1'300	0	0	1'300 EUR	76.53%	975'694.89	0.06	a)
X52432162654	1.7500 % CPIPGR 1 3/4 01/14/30 EMTN	3'800	0	3'800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>LU</b>							<b>8'969'882.87</b>	<b>0.54</b>	
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	300'000	0	0	300'000 MXN	88.58%	1'430'460.23	0.09	a)
X50699618350	5.0000 % AMXLMM 5 10/27/26	700	0	0	700 GBP	99.00%	795'879.85	0.05	a)
X52754067242	4.4899 % MEX 4.4899 05/25/32	0	5'900	2'500	3'400 EUR	99.71%	3'324'734.71	0.20	a)
<b>MX</b>							<b>5'551'074.79</b>	<b>0.34</b>	
MYBMIZ300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	10'000	3'000	0	13'000 MYR	99.09%	2'475'551.64	0.15	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	10'000	0	0	10'000 MYR	97.20%	1'867'853.54	0.11	a)
<b>MY</b>							<b>4'343'405.18</b>	<b>0.26</b>	
CA639832AA25	5.2000 % NEDWBK 5.2 03/31/25 EMTN	0	1'000	0	1'000 CAD	100.13%	668'431.02	0.04	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	4'000	0	1'200	2'800 EUR	97.71%	2'682'852.29	0.16	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	1'000	0	0	1'000 EUR	46.51%	456'147.85	0.03	a)
US456837BB82	4.0170 % INTNED 4.017 03/28/28	1'200	0	0	1'200 USD	95.34%	1'049'303.98	0.06	a)
US456837BH52	6.1140 % INTNED 6.114 09/11/34	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	



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.
US749775DJ87	1.0040 % RABOBK 1.004 09/24/26 REGS	2'000	2'300	0	4'300 USD	93.53%	3'688'624.14	0.22	a)
US822582CC49	2.0000 % RDSALN 2 11/07/24	0	600	0	600 USD	98.40%	541'479.86	0.03	a)
USN30706VC11	1.3750 % ENELIM 1 3/8 07/12/26 REGS	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USN4580HAC18	1.4000 % INTNED 1.4 07/01/26 REGS	2'300	3'000	0	5'300 USD	94.90%	4'613'135.18	0.28	a)
XS1586228824	1.5000 % BNG 1 1/2 03/29/38 EMTN	3'000	0	0	3'000 EUR	79.63%	2'342'835.13	0.14	a)
XS1596070547	3.0000 % MUBAUH 3 04/19/24 GMTN	2'195	0	2'195	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1987905913	1.9700 % RABOBK 1.97 05/29/24 EMTN	1'334	0	0	1'334 USD	99.66%	1'219'281.57	0.07	a)
XS2065581212	1.5000 % BNG 1 1/2 10/16/24 REGS	2'000	10'000	0	12'000 USD	98.20%	10'807'475.48	0.65	a)
XS2199719233	0.1250 % BNG 0 1/8 07/09/35	1'000	0	0	1'000 EUR	71.61%	702'266.06	0.04	a)
XS2265251905	0.5000 % NEDWBK 0 1/2 12/02/25 REGS	1'100	0	0	1'100 USD	92.74%	935'661.76	0.06	a)
XS2343566662	0.8750 % BNG 0 7/8 05/18/26 REGS	0	2'000	0	2'000 USD	91.71%	1'682'254.87	0.10	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	0	800	0	800 EUR	89.90%	705'319.86	0.04	a)
XS2384269366	0.7500 % HEIBOS 0 3/4 09/06/29 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2388141892	1.0000 % ADENVX 1 03/21/2082	0	3'300	3'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2434791690	0.8750 % CTPNV 0 7/8 01/20/26 EMTN	1'300	0	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2435603571	0.6250 % HEIBOS 0 5/8 07/24/25 EMTN	0	580	580	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2679898184	4.8750 % REWEEG 4 7/8 09/13/30	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2694995163	3.6250 % ASRNBK 3 5/8 12/12/28	0	1'700	800	900 EUR	99.27%	876'184.56	0.05	a)
XS2697483118	4.1250 % INTNED 4 1/8 10/02/26 EMTN	1'500	0	0	1'500 EUR	100.96%	1'485'108.70	0.09	a)
XS2715940891	4.2200 % SDZSW 4.22 04/17/30	0	2'400	2'400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	4'300	4'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	0	3'350	3'350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2729201330	1.0530 % INTNED 1.053 12/07/28 EMTN	0	900'000	0	900'000 JPY	99.48%	5'218'077.16	0.32	a)
XS2744491874	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 01/10/34	0	4'100	0	4'100 EUR	95.73%	3'848'972.29	0.23	a)
XS2770920184	1.2220 % RABOBK 1.222 02/26/30 EMTN	0	1'000'000	0	1'000'000 JPY	99.06%	5'773'093.79	0.35	a)
XS2782937937	3.6100 % RANDNA 3.61 03/12/29 EMTN	0	6'700	2'700	4'000 EUR	98.69%	3'871'127.54	0.23	a)
<b>NL</b>							<b>53'167'633.09</b>	<b>3.22</b>	
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	10'000	35'000	0	45'000 NOK	86.54%	3'225'220.32	0.20	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	17'000	0	17'000 NOK	93.48%	1'316'084.18	0.08	a)
US25601C2881	1.6050 % DNBNO 1.605 03/30/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	88.72%	813'695.48	0.05	a)
US656531AG58	6.8000 % EQNR 6.8 01/15/28	1'500	0	0	1'500 USD	104.69%	1'440'232.75	0.09	a)
XS1188118100	2.1250 % KBN 2 1/8 02/11/25 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	97.41%	1'072'096.99	0.06	a)
XS2189767515	1.1250 % KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	79.74%	731'344.58	0.04	a)
XS2465774474	2.6250 % DNBNO 2 5/8 06/10/26	2'300	0	0	2'300 GBP	96.91%	2'559'724.10	0.15	a)
XS2723597923	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/26 EMTN	0	5'100	0	5'100 EUR	99.10%	4'956'593.49	0.30	a)
XS2779793061	3.7500 % STATK 3 3/4 03/22/39 EMTN	0	1'600	0	1'600 EUR	100.24%	1'572'818.65	0.10	a)
<b>NO</b>							<b>17'687'810.54</b>	<b>1.07</b>	
AU3CB0301240	4.7000 % NZLGFA 4.7 08/01/28 MTN	300	0	300	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
NZLIBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	3'500	0	0	3'500 NZD	124.41%	2'363'151.13	0.14	a)
US00182FBU93	5.3550 % ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS	2'650	0	0	2'650 USD	99.61%	2'420'895.84	0.15	a)
US00216NAD12	1.6250 % ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	90.88%	1'416'882.11	0.09	a)
US00216NAE94	2.3750 % ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS	0	2'600	0	2'600 USD	79.56%	1'897'060.57	0.11	a)
US06407F2F85	2.8700 % BZLNZ 2.87 01/27/32 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	82.05%	752'539.92	0.05	a)
XS1245411233	4.5000 % FCGNZ 4 1/2 07/17/25 EMTN	30'000	0	0	30'000 CNY	101.54%	3'851'867.02	0.23	a)
XS1515173315	0.7500 % FCGNZ 0 3/4 11/08/24 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	98.36%	1'929'169.81	0.12	a)
XS2343772724	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	0	1'500	0	1'500 EUR	80.17%	1'179'258.00	0.07	a)
XS2353483733	0.0100 % BZLNZ 0.01 06/15/28	1'000	0	0	1'000 EUR	86.65%	849'787.93	0.05	a)
<b>NZ</b>							<b>16'660'612.33</b>	<b>1.01</b>	
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	1'500	1'000	1'200	1'300 USD	96.62%	1'152'019.27	0.07	a)
<b>PE</b>							<b>1'152'019.27</b>	<b>0.07</b>	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	7'000	0	0	7'000 PLN	90.52%	1'436'169.48	0.09	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	3'000	0	0	3'000 PLN	87.05%	591'925.90	0.04	a)
PL0000115291	6.0000 % POLGB 6 10/25/33 1033	0	10'000	0	10'000 PLN	101.96%	2'310'996.82	0.14	a)
XS2711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2778272471	4.0000 % BGOSK 4 03/13/32 EMTN	0	3'400	0	3'400 EUR	99.51%	3'317'866.11	0.20	a)
XS2778274410	4.3750 % BGOSK 4 3/8 03/13/39 EMTN	0	5'600	2'800	2'800 EUR	99.18%	2'723'271.50	0.16	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.
<b>PL</b>							<b>10'380'229.81</b>	<b>0.63</b>	
XS2357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
<b>QA</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
XS2258400162	2.6250 % ROMANI 2 5/8 12/02/40 REGS	0	1'350	250	1'100 EUR	65.49%	706'452.53	0.04	a)
XS2770921315	5.6250 % ROMANI 5 5/8 02/22/36 REGS	0	3'370	770	2'600 EUR	98.58%	2'513'530.18	0.15	a)
<b>RO</b>							<b>3'219'982.71</b>	<b>0.19</b>	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'000	0	0	5'000 SEK	110.82%	462'995.37	0.03	a)
US01021NAA00	4.2500 % SEK 4 1/4 02/01/29 GMTN	0	4'800	0	4'800 USD	97.20%	4'279'143.09	0.26	a)
US87031CAE30	2.2500 % SEK 2 1/4 03/22/27 GMTN	0	1'800	0	1'800 USD	92.39%	1'525'156.25	0.09	a)
USW8454EAT56	5.1250 % SEB 5 1/8 03/05/27 REGS	0	850	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2198237039	0.4230 % SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN	400'000	0	0	400'000 JPY	99.58%	2'321'569.93	0.14	a)
XS2226974504	0.1250 % SWED 0 1/8 09/09/30 REGS	4'000	0	0	4'000 SEK	86.31%	288'497.12	0.02	a)
XS2667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	2'750	0	1'750	1'000 EUR	102.67%	1'006'812.47	0.06	a)
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	2'200	0	2'200 EUR	100.87%	2'176'174.55	0.13	a)
XS2717300391	4.1250 % SWEDA 4 1/8 11/13/28 GMTN	0	4'500	4'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2748970402	3.7500 % LFBANK 3 3/4 01/17/29 EMTN	0	8'050	3'250	4'800 EUR	99.61%	4'688'988.84	0.28	a)
<b>SE</b>							<b>16'749'337.62</b>	<b>1.01</b>	
AU3CB0302107	4.7530 % CLFCAP 4.753 08/31/28 MTN	2'000	0	2'000	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	3'900	0	0	3'900 SGD	97.38%	2'554'059.80	0.15	a)
US233045AC70	2.3750 % DBSSP 2 3/8 03/17/27 REGS	3'500	0	0	3'500 USD	92.14%	2'957'781.24	0.18	a)
US449276AE42	4.9000 % IBM 4.9 02/05/34	0	8'000	2'000	6'000 USD	94.69%	5'210'475.89	0.32	a)
US449276AG99	5.3000 % IBM 5.3 02/05/54	0	2'000	0	2'000 USD	91.26%	1'674'055.55	0.10	a)
XS2310058891	1.8220 % DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	1'500	3'650	0	5'150 USD	92.94%	4'389'619.77	0.27	a)
XS2463967369	4.5000 % UOBSP 4 1/2 04/06/32 GMTN	27'000	0	27'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
<b>SG</b>							<b>16'785'992.25</b>	<b>1.02</b>	
AT0000A377W8	5.3750 % SLOSP0 5 3/8 10/04/28 EMTN	1'600	0	1'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
SK4000024865	3.7500 % SLOVGB 3 3/4 03/06/34 250	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
<b>SK</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
TH0623036C06	2.1250 % THAIGB 2 1/8 12/17/26	50'000	0	0	50'000 THB	99.34%	1'229'181.63	0.07	a)
TH0623036I02	3.3000 % THAIGB 3.3 06/17/38	30'000	0	0	30'000 THB	102.84%	763'546.05	0.05	a)
TH062303M604	2.0000 % THAIGB 2 06/17/42	20'000	0	0	20'000 THB	83.50%	413'281.81	0.03	a)
TH0623A3C606	3.7750 % THAIGB 3.775 06/25/32	30'000	0	0	30'000 THB	107.66%	799'301.54	0.05	a)
TH0623X3BC03	2.0000 % THAIGB 2 12/17/31	0	50'000	0	50'000 THB	95.19%	1'177'879.63	0.07	a)
<b>TH</b>							<b>4'383'190.66</b>	<b>0.27</b>	
AU3CB0278885	3.8500 % VZ 3.85 03/23/41 MTN	1'000	0	0	1'000 AUD	69.77%	415'534.04	0.03	a)
US00287YBX67	3.2000 % ABBV 3.2 11/21/29	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BJ41	4.7500 % APD 4 3/4 02/08/31	0	9'500	9'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US009158BK14	4.8500 % APD 4.85 02/08/34	0	5'800	2'800	3'000 USD	95.58%	2'629'835.91	0.16	a)
US023135BC96	3.1500 % AMZN 3.15 08/22/27	0	2'200	0	2'200 USD	94.20%	1'900'620.95	0.12	a)
US023135BY17	1.6500 % AMZN 1.65 05/12/28	0	2'500	0	2'500 USD	87.74%	2'011'814.38	0.12	a)
US025816DP17	5.0980 % AXP 5.098 02/16/28	0	2'225	2'225	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US025816DT39	5.6450 % AXP 5.645 04/23/27	0	3'600	0	3'600 USD	100.06%	3'303'688.03	0.20	a)
US03073EAT29	2.7000 % COR 2.7 03/15/31	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US031162CY49	2.7700 % AMGN 2.77 09/01/53	0	5'500	2'500	3'000 USD	58.06%	1'597'381.81	0.10	a)
US037833EG11	2.8000 % AAPL 2.8 02/08/61	0	3'500	0	3'500 USD	58.83%	1'888'297.21	0.11	a)
US04685A3B58	5.9192 % ATH FLOAT 08/19/24 144A	2'000	0	1'000	1'000 USD	100.06%	917'672.78	0.06	a)
US04686E3F70	0.9140 % ATH 0.914 08/19/24 REGS	3'200	0	0	3'200 USD	98.41%	2'888'215.41	0.17	a)
US04686E3H37	1.9850 % ATH 1.985 08/19/28 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	85.28%	1'564'254.35	0.09	a)
US06051GJZ37	2.0870 % BAC 2.087 06/14/29 MTN	2'300	4'500	900	5'900 USD	86.99%	4'707'243.94	0.28	a)
US06051GLH01	5.2880 % BAC 5.288 04/25/34	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US06428CAA27	5.5260 % BAC 5.526 08/18/26	6'000	0	0	6'000 USD	100.24%	5'516'161.99	0.33	a)
US06428CAC82	5.6500 % BAC 5.65 08/18/25	4'000	0	0	4'000 USD	100.16%	3'674'469.76	0.22	a)
US110122DQ80	1.4500 % BMY 1.45 11/13/30	0	1'000	0	1'000 USD	78.90%	723'668.04	0.04	a)
US110122EH72	5.2000 % BMY 5.2 02/22/34	0	2'840	2'840	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EK02	5.5500 % BMY 5.55 02/22/54	0	1'960	1'960	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US110122EL84	5.6500 % BMY 5.65 02/22/64	0	2'400	0	2'400 USD	95.84%	2'109'525.71	0.13	a)
US126650DQ03	1.8750 % CVS 1 7/8 02/28/31	0	1'000	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US126650DV97	5.6250 % CVS 5 5/8 02/21/53	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US172967ML25	2.6660 % C 2.666 01/29/31	0	2'500	0	2'500 USD	84.90%	1'946'605.02	0.12	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.
US172967MQ12	3.1060 % C 3.106 04/08/26	0	2'000	0	2'000 USD	97.46%	1'787'617.07	0.11	a)
US172967NA50	1.4620 % C 1.462 06/09/27	2'500	700	0	3'200 USD	91.56%	2'687'117.43	0.16	a)
US17325FBB31	5.8030 % C 5.803 09/29/28	5'500	0	3'500	2'000 USD	101.84%	1'867'959.41	0.11	a)
US17327CAQ69	3.0570 % C 3.057 01/25/33	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US19828TAA43	5.9270 % CPGX 5.927 08/15/30 144A	1'180	0	1'180	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US20030NDN84	1.5000 % CMCSA 1 1/2 02/15/31	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278642AV58	1.9000 % EBAY 1.9 03/11/25	0	2'200	0	2'200 USD	96.87%	1'954'575.05	0.12	a)
US278642AY97	2.6000 % EBAY 2.6 05/10/31	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US278865BJ87	2.7500 % ECL 2 3/4 08/18/55	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US285512AE93	1.8500 % EA 1.85 02/15/31	0	750	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US29444UBL98	1.5500 % EQIX 1.55 03/15/28	0	1'400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045VAT70	5.9500 % GM 5.95 04/01/49	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XED49	6.4000 % GM 6.4 01/09/33	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEH52	5.8000 % GM 5.8 06/23/28	2'100	0	2'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XEQ51	5.4000 % GM 5.4 05/08/27	0	1'300	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US37045XER35	5.7500 % GM 5 3/4 02/08/31	0	800	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38141GZK39	2.6400 % GS 2.64 02/24/28	900	0	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US38145GAM24	5.7980 % GS 5.798 08/10/26	1'150	0	0	1'150 USD	99.93%	1'054'026.38	0.06	a)
US437076CJ91	1.8750 % HD 1 7/8 09/15/31	0	4'000	2'500	1'500 USD	79.53%	1'094'072.82	0.07	a)
US44891CBX02	2.0000 % HYNMTR 2 06/15/28 REGS	1'700	0	0	1'700 USD	86.33%	1'346'065.29	0.08	a)
US44891CCH43	5.6800 % HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS	750	0	750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US44891CCN11	6.1000 % HYNMTR 6.1 09/21/28 REGS	2'650	0	2'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140BK55	3.1000 % INTC 3.1 02/15/60	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US458140CG35	5.2000 % INTC 5.2 02/10/33	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US459200KZ37	5.1000 % IBM 5.1 02/06/53	0	4'000	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46625HJY71	3.8750 % JPM 3 7/8 09/10/24	4'500	0	0	4'500 USD	99.30%	4'098'408.59	0.25	a)
US46647PCU84	2.9630 % JPM 2.963 01/25/33	0	3'100	600	2'500 USD	83.19%	1'907'511.50	0.12	a)
US46647PCU84XXX	2.9630 % *RETIRED*	3'100	0	3'100	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US46647PEA03	5.0400 % JPM 5.04 01/23/28	0	1'100	0	1'100 USD	98.57%	994'407.96	0.06	a)
US532457BZ08	2.5000 % LLY 2 1/2 09/15/60	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US548661EF07	4.4500 % LOW 4.45 04/01/62	3'000	0	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US57629W4S64	5.1000 % MASSMU 5.1 04/09/27 144A	0	4'000	0	4'000 USD	99.44%	3'648'129.21	0.22	a)
US57629W5B21	4.8500 % MASSMU 4.85 01/17/29 144A	12'000	0	5'100	6'900 USD	97.61%	6'177'214.36	0.37	a)
US57636QAU85	2.0000 % MA 2 11/18/31	0	1'650	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBF16	2.7500 % MRK 2 3/4 12/10/51	0	1'350	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US58933YBG98	2.9000 % MRK 2.9 12/10/61	0	1'500	0	1'500 USD	58.21%	800'864.55	0.05	a)
US58989V2H68	5.2500 % MET 5 1/4 04/12/29 144A	0	1'500	0	1'500 USD	98.79%	1'359'051.21	0.08	a)
US594918CF95	3.0410 % MSFT 3.041 03/17/62	0	3'500	3'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US61690U7W40	5.8820 % MS 5.882 10/30/26 BKNT	6'000	0	2'000	4'000 USD	100.88%	3'700'920.37	0.22	a)
US61690U8A11	4.9520 % MS 4.952 01/14/28 BKNT	0	3'000	0	3'000 USD	98.45%	2'708'802.53	0.16	a)
US6174468G77	4.4310 % MS 4.431 01/23/30 GMTN	0	3'000	0	3'000 USD	95.12%	2'617'096.70	0.16	a)
US61747YFG52	5.4240 % MS 5.424 07/21/34 MTN	1'575	0	0	1'575 USD	97.06%	1'401'970.39	0.08	a)
US64952XEZ06	4.9000 % NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US682680BN20	6.6250 % OKE 6 5/8 09/01/53	4'500	0	4'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US744320BH48	3.7000 % PRU 3.7 10/01/50	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US80282KBH86	7.6600 % SANUSA 7.66 11/09/31	0	3'400	1'600	1'800 USD	106.87%	1'764'350.80	0.11	a)
US832696AW80	5.9000 % SJM 5.9 11/15/28	1'650	0	1'650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US832696AZ12	6.5000 % SJM 6 1/2 11/15/53	3'700	0	3'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US87264ADF93	5.1500 % TMUS 5.15 04/15/34	0	3'800	3'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797JA69	0.0000 % B 01/23/24	0	6'000	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	5'000	0	0	5'000 USD	87.05%	3'991'752.07	0.24	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	17'000	8'000	4'000	21'000 USD	77.25%	14'878'465.88	0.90	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	33'000	6'500	0	39'500 USD	74.83%	27'108'302.87	1.64	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	11'000	0	0	11'000 USD	77.03%	7'771'413.20	0.47	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	0	3'500	0	3'500 USD	73.28%	2'352'346.45	0.14	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	3'000	0	0	3'000 USD	73.06%	2'010'278.16	0.12	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	4'000	0	0	4'000 USD	72.92%	2'675'211.91	0.16	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	5'000	4'000	0	9'000 USD	47.23%	3'898'890.63	0.24	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	15'000	0	0	15'000 USD	48.80%	6'713'108.09	0.41	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	14'000	0	0	14'000 USD	58.84%	7'555'596.34	0.46	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.
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	2'500	0	0	2'500 USD	55.84%	1'280'427.38	0.08	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	18'000	0	0	18'000 USD	65.70%	10'846'731.80	0.66	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	8'000	0	0	8'000 USD	57.42%	4'213'157.81	0.25	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	26'000	14'500	3'500	37'000 USD	55.47%	18'823'070.70	1.14	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	14'000	5'000	3'000	16'000 USD	60.98%	8'949'091.13	0.54	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	0	8'000	0	8'000 USD	70.38%	5'163'554.50	0.31	a)
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	8'500	10'500	0	19'000 USD	84.59%	14'739'713.15	0.89	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	7'000	5'000	2'000 USD	81.73%	1'499'253.64	0.09	a)
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	0	9'000	3'000	6'000 USD	91.58%	5'039'452.64	0.30	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	0	6'000	2'000	4'000 USD	92.49%	3'393'168.41	0.21	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	11'000	0	7'000	4'000 USD	91.69%	3'363'647.63	0.20	a)
US9128283R96	0.5000 % TII 0 1/2 01/15/28	1'000	0	0	1'000 USD	117.48%	1'077'506.98	0.07	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	4'000	0	4'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V491	0.3750 % TII 0 3/8 01/15/27	2'000	0	0	2'000 USD	121.47%	2'228'179.58	0.13	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	7'000	0	0	7'000 USD	98.64%	6'332'777.45	0.38	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	0	11'000	9'000	2'000 USD	98.43%	1'805'495.77	0.11	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	0	4'170	4'170	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	7'000	0	3'000	4'000 USD	85.97%	3'153'849.56	0.19	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZZ63	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/30	1'500	0	0	1'500 USD	106.66%	1'467'346.25	0.09	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	0	17'000	10'000	7'000 USD	78.75%	5'055'789.38	0.31	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	5'970	0	5'970	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	5'000	0	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	0	5'000	5'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	0	13'000	8'000	5'000 USD	86.19%	3'952'343.28	0.24	a)
US91282CCA71	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/26	2'000	0	0	2'000 USD	112.75%	2'068'144.78	0.13	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	0	15'000	0	15'000 USD	81.83%	11'257'299.73	0.68	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	7'000	0	3'000	4'000 USD	99.80%	3'661'148.16	0.22	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	7'000	0	7'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	8'000	7'000	5'000	10'000 USD	81.73%	7'496'268.20	0.45	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	5'000	0	0	5'000 USD	97.03%	4'449'431.43	0.27	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	6'000	0	6'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CHP95	1.3750 % TII 1 3/8 07/15/33	2'000	2'000	0	4'000 USD	94.86%	3'480'007.91	0.21	a)
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	4'000	0	4'000 USD	94.70%	3'474'278.84	0.21	a)
US91324PCQ37	4.6250 % UNH 4 5/8 07/15/35	0	2'000	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PEA66	3.1250 % UNH 3 1/8 05/15/60	0	3'000	3'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91324PFD96	5.5000 % UNH 5 1/2 04/15/64	0	8'000	2'500	5'500 USD	94.89%	4'786'509.55	0.29	a)
US92343VGN82	2.3550 % VZ 2.355 03/15/32	2'800	0	2'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US92343VGW81	5.5000 % VZ 5 1/2 02/23/54	0	1'850	1'850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US94988J6D46	5.4500 % WFC 5.45 08/07/26 BKNT	5'250	0	0	5'250 USD	99.94%	4'812'196.63	0.29	a)
USQ6684MAB92	5.7500 % NEM 5 3/4 11/15/41 REGS	0	4'010	4'010	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU3822UAA89	5.0000 % HWQCUS 5 07/27/28 REGS	2'400	0	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USU75000BS44	0.9910 % ROSW 0.991 03/05/26 REGS	0	1'200	0	1'200 USD	92.49%	1'017'915.44	0.06	a)
USU75000BY12	2.6070 % ROSW 2.607 12/13/51 REGS	0	1'950	0	1'950 USD	59.17%	1'058'132.01	0.06	a)
USU75000CH79	5.5930 % ROSW 5.593 11/13/33 REGS	0	1'600	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1323463726	1.6250 % UPS 1 5/8 11/15/25	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1512978112	0.3000 % IBM 0.3 11/02/26	300'000	0	0	300'000 JPY	98.62%	1'724'252.44	0.10	a)
XS1556040936	0.9320 % AFL 0.932 01/25/27	500'000	0	0	500'000 JPY	99.86%	2'910'063.56	0.18	a)
XS1580340260	0.3720 % SBUX 0.372 03/15/24	600'000	200'000	800'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
XS1645684157	0.2980 % WMT 0.298 07/18/24	100'000	0	0	100'000 JPY	99.97%	582'630.50	0.04	a)
XS1645684314	0.5200 % WMT 0.52 07/16/27	100'000	0	0	100'000 JPY	98.59%	574'622.59	0.03	a)
XS1659697665	0.6980 % GLW 0.698 08/09/24	250'000	0	0	250'000 JPY	99.92%	1'455'847.73	0.09	a)
XS1762729538	4.6500 % C 4.65 06/12/24 GMTN	3'000	0	0	3'000 USD	99.78%	2'745'506.87	0.17	a)
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	93.42%	1'832'338.67	0.11	a)
XS2045001935	2.0500 % C 2.05 09/30/25 EMTN	1'500	1'806	0	3'306 USD	94.72%	2'872'124.41	0.17	a)
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	0	850	0	850 EUR	78.77%	656'626.27	0.04	a)
XS2056488013	1.8000 % TOYOTA 1.8 10/22/26 EMTN	2'700	0	0	2'700 USD	91.44%	2'264'234.24	0.14	a)
XS2079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	0	700	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	0	1'200	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193854804	0.8500 % PLD 0.85 06/24/30	300'000	0	0	300'000 JPY	94.71%	1'655'975.43	0.10	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

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.
X52233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	0	1'300	1'300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	1'500	950	0	2'450 EUR	82.67%	1'986'331.47	0.12	a)
X52330256236	0.6330 % AFL 0.633 04/15/31	0	550'000	0	550'000 JPY	94.25%	3'021'209.68	0.18	a)
X52335966631	0.9910 % JPM 0.991 04/28/26	0	800	0	800 GBP	95.72%	879'369.21	0.05	a)
X52343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52404272572	0.1100 % PG 0.11 11/06/26	0	100'000	0	100'000 JPY	98.74%	575'456.02	0.03	a)
X52410427079	4.0600 % C 4.06 03/28/24 GMTN	4'000	0	4'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
X52462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	1'000	0	0	1'000 EUR	92.61%	908'147.47	0.05	a)
X52548076053	0.8530 % TMO 0.853 10/20/25	300'000	0	0	300'000 JPY	99.76%	1'744'202.26	0.11	a)
X52548076301	1.0540 % TMO 1.054 10/20/27	300'000	200'000	0	500'000 JPY	98.93%	2'882'933.43	0.17	a)
X52597740476	4.1090 % NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN	1'000	0	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52634234020	0.8130 % PYPL 0.813 06/09/25	200'000	0	0	200'000 JPY	100.06%	1'166'345.04	0.07	a)
X52634234293	0.9720 % PYPL 0.972 06/09/26	360'000	0	0	360'000 JPY	99.94%	2'096'966.24	0.13	a)
X52634234376	1.2400 % PYPL 1.24 06/09/28	230'000	0	0	230'000 JPY	99.42%	1'332'757.94	0.08	a)
X52731506841	3.7500 % MET 3 3/4 12/07/31 GMTN	0	5'450	3'150	2'300 EUR	101.05%	2'279'241.76	0.14	a)
X52747270630	3.9000 % GM 3.9 01/12/28 EMTN	0	2'600	2'600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52747557416	4.8750 % SKBTAM 4 7/8 01/23/27	0	2'200	0	2'200 USD	98.00%	1'977'456.11	0.12	a)
X52753287585	4.8750 % SKBTAM 4 7/8 01/23/27	0	2'200	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
X52776511730	3.6250 % BKNG 3 5/8 03/01/32	0	5'400	1'900	3'500 EUR	99.32%	3'409'100.59	0.21	a)
X52790333707	3.7900 % MS 3.79 03/21/30	0	3'700	0	3'700 EUR	99.48%	3'609'566.75	0.22	a)
X52790333889	3.9550 % MS 3.955 03/21/35	0	5'200	1'400	3'800 EUR	99.18%	3'695'868.46	0.22	a)
X52791972248	3.7610 % JPM 3.761 03/21/34 EMTN	0	4'700	0	4'700 EUR	99.25%	4'574'524.31	0.28	a)
<b>US</b>							<b>365'080'105.72</b>	<b>22.09</b>	
AU3CB0230134	4.5000 % CAF 4 1/2 06/05/25 MTN	1'094	0	0	1'094 AUD	98.82%	643'832.05	0.04	a)
<b>VE</b>							<b>643'832.05</b>	<b>0.04</b>	
AU3CB0215614	6.2500 % CAF 6 1/4 11/08/23 MTN	715	0	715	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3CB0295764	4.7500 % EIB 4 3/4 01/20/33	1'300	0	200	1'100 AUD	97.84%	640'962.74	0.04	a)
AU3CB0306678	5.3000 % CAF 5.3 02/19/29 MTN	0	8'000	1'000	7'000 AUD	98.59%	4'110'245.29	0.25	a)
CA459058KM45	3.7000 % IBRD 3.7 01/18/28	3'000	0	0	3'000 CAD	98.07%	1'964'076.88	0.12	a)
EU000A3K4D74	3.3750 % EU 3 3/8 10/04/38 NGEU	7'500	0	7'500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DT4	2.5000 % EU 2 1/2 10/04/52 NGEU	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3K4DV0	3.3750 % EU 3 3/8 11/04/42 NGEU	0	1'000	0	1'000 EUR	100.38%	984'384.59	0.06	a)
EU000A3K4DW8	2.7500 % EU 2 3/4 02/04/33 NGEU	4'000	0	1'200	2'800 EUR	97.99%	2'690'595.64	0.16	a)
EU000A3K4DY4	3.0000 % EU 3 03/04/53 NGEU	3'000	1'500	3'000	1'500 EUR	92.61%	1'362'265.34	0.08	a)
EU000A3KSXE1	0.0000 % EU 0 07/04/31 NGEU	0	3'000	3'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
EU000A3KTGW6	0.7000 % EU 0.7 07/06/51 NGEU	2'000	0	0	2'000 EUR	53.81%	1'055'394.75	0.06	a)
JPS00113AL71	0.7700 % CAF 0.77 07/30/25 14	100'000	0	0	100'000 JPY	100.04%	583'050.13	0.04	a)
US008281BF39	5.7500 % AFDB 5 3/4 PERP	0	5'000	0	5'000 USD	93.75%	4'299'140.63	0.26	a)
US04522KAA43	2.2500 % AIB 2 1/4 05/16/24	0	1'200	0	1'200 USD	99.88%	1'099'215.28	0.07	a)
US15238RAJ14	5.0000 % CABEL 5 01/25/27 REGS	0	700	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US219868CE41	1.2500 % CAF 1 1/4 10/26/24	0	1'000	0	1'000 USD	97.81%	897'055.24	0.05	a)
US29874QAY08	1.6250 % EBRD 1 5/8 09/27/24	2'000	0	0	2'000 USD	98.47%	1'806'216.87	0.11	a)
US298785HM16	2.3750 % EIB 2 3/8 05/24/27	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785HT68	3.1250 % EIB 3 1/8 12/14/23 GMTN	1'300	0	1'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JA59	1.6250 % EIB 1 5/8 10/09/29	0	5'000	0	5'000 USD	84.99%	3'897'337.21	0.24	a)
US298785JK32	0.3750 % EIB 0 3/8 03/26/26	0	3'110	2'110	1'000 USD	91.51%	839'283.97	0.05	a)
US298785JS67	2.7500 % EIB 2 3/4 08/15/25	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US298785JT41	3.2500 % EIB 3 1/4 11/15/27	0	1'650	0	1'650 USD	94.71%	1'433'198.66	0.09	a)
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	0	1'000	0	1'000 USD	85.05%	780'045.25	0.05	a)
US4581X0EN43	4.1250 % IADB 4 1/8 02/15/29	0	11'900	2'900	9'000 USD	97.05%	8'010'681.59	0.48	a)
US459058JB07	0.6250 % IBRD 0 5/8 04/22/25	0	700	0	700 USD	95.58%	613'602.70	0.04	a)
US459058KA05	1.6250 % IBRD 1 5/8 11/03/31	2'500	0	0	2'500 USD	80.08%	1'836'065.51	0.11	a)
US459058KJ14	3.1250 % IBRD 3 1/8 06/15/27	0	500	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US45950VHX73	2.1250 % IFC 2 1/8 04/07/26 GMTN	1'250	0	0	1'250 USD	94.57%	1'084'208.87	0.07	a)
X50070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	0	1'000	0	1'000 USD	88.26%	809'494.93	0.05	a)
X50282506657	2.1500 % EIB 2.15 01/18/27	100'000	0	0	100'000 JPY	105.04%	612'179.32	0.04	a)
X50307424274	2.3500 % ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	100'000	170'000	0	270'000 JPY	106.32%	1'673'120.74	0.10	a)
X50876282137	0.0000 % EIB 0 01/18/33 GDIF	10'000	0	0	10'000 JPY	92.79%	54'079.01	0.00	a)
X51003743827	3.3100 % CAF 3.31 12/12/28 EMTN	0	2'000	0	2'000 EUR	96.84%	1'899'279.06	0.11	a)
X51225179420	1.9500 % IBRD 1.95 05/08/25 GDIF	0	10'000	0	10'000 USD	96.16%	8'819'130.97	0.53	a)
X51562584158	0.0000 % AFDB 0 02/09/32 GDIF	0	100'000	0	100'000 MXN	46.93%	2'526'368.05	0.15	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.
XS1751359016	1.3750 % EIB 1 3/8 05/12/28 EMTN	20'000	0	0	20'000 SEK	92.91%	1'552'785.27	0.09	a)
XS1757690992	5.7500 % EIB 5 3/4 01/24/25 REGS	10'000'000	0	0	10'000'000 IDR	99.17%	559'412.33	0.03	a)
XS1789715064	8.5000 % CAF 8 1/2 03/08/28 EMTN	50'000	0	0	50'000 MXN	91.17%	2'453'727.02	0.15	a)
XS1821973606	6.7700 % CAF 6.77 05/24/28 EMTN	0	13'000'000	0	13'000'000 COP	84.44%	2'586'715.91	0.16	a)
XS2045838039	6.6923 % CABEI FLOAT 11/15/24 EMTN	3'305	0	0	3'305 USD	100.28%	3'039'607.43	0.18	a)
XS2288938546	2.0000 % EBRD 2 01/21/25 GMTN	12'000	0	0	12'000 CNY	99.28%	1'506'453.02	0.09	a)
XS2289410420	0.2000 % IBRD 0.2 01/21/61	2'000	0	0	2'000 EUR	36.31%	712'121.77	0.04	a)
XS2289822376	1.0000 % EIB 1 01/28/28 REGS	1'000	0	0	1'000 CAD	88.80%	592'801.27	0.04	a)
XS2290963466	0.0500 % EIB 0.05 01/27/51	2'000	0	0	2'000 EUR	43.42%	851'553.13	0.05	a)
XS2296027217	0.2500 % CAF 0 1/4 02/04/26	0	1'800	0	1'800 EUR	93.62%	1'652'493.99	0.10	a)
XS2296644094	4.2500 % EBRD 4 1/4 02/07/28 EMTN	20'000'000	10'000'000	0	30'000'000 IDR	92.04%	1'557'592.92	0.09	a)
XS2311552363	5.0000 % AIIB 5 03/05/26 GMTN	30'000	0	0	30'000 MXN	89.35%	1'442'862.22	0.09	a)
XS2318315921	2.5000 % AIIB 2 1/2 03/24/25 GMTN	10'000	10'030	0	20'030 CNY	99.45%	2'518'928.30	0.15	a)
XS2332164966	2.7000 % EIB 2.7 04/22/24 EMTN	40'000	38'000	78'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2388085370	2.5000 % ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN	0	55'000	0	55'000 CNY	99.04%	6'888'301.99	0.42	a)
XS2406749478	5.1000 % IADB 5.1 11/17/26 EMTN	20'000'000	0	0	20'000'000 IDR	96.36%	1'087'122.24	0.07	a)
XS2437747210	2.2500 % IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN	0	70'000	0	70'000 CNY	97.34%	8'615'920.83	0.52	a)
XS2457458854	3.0500 % IBRD 3.05 03/16/24 EMTN	10'000	0	10'000	0 CNY	0.00%	0.00	0.00	
XS2472637136	2.7500 % EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN	0	12'500	0	12'500 CNY	98.47%	1'556'434.44	0.09	a)
XS2495583978	2.3750 % CAF 2 3/8 07/13/27 EMTN	4'900	0	1'900	3'000 EUR	95.56%	2'811'319.78	0.17	a)
XS2539449608	2.6000 % EIB 2.6 09/29/26 EMTN	20'000	0	0	20'000 CNY	99.43%	2'514'523.31	0.15	a)
XS2574388562	6.0000 % EBRD 6 01/17/30 GMTN	30'000'000	10'000'000	0	40'000'000 IDR	96.33%	2'173'499.86	0.13	a)
XS2577528107	2.7500 % IBRD 2 3/4 01/19/27 EMTN	0	20'000	0	20'000 CNY	99.62%	2'519'505.52	0.15	a)
XS2594907664	4.5000 % CAF 4 1/2 03/07/28	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2707161308	2.5000 % IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	60'000	140'000	0	200'000 CNY	97.14%	24'567'853.27	1.49	a)
XS2749537481	3.2000 % IDAWBG 3.2 01/18/44 GMTN	0	5'500	0	5'500 EUR	96.94%	5'228'788.64	0.32	a)
XS2758114164	4.6250 % OFIDEV 4 5/8 02/08/27 REGS	0	2'800	0	2'800 USD	98.08%	2'518'611.30	0.15	a)
<b>XS</b>							<b>137'889'614.98</b>	<b>8.34</b>	

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

0.00 0.00

#### Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

0.00 0.00

CH0215801199 SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLBL AGGRT NT CHF

0 362'219 362'219 0 CHF 0.00 0.00 0.00

CH

0.00 0.00

#### Derivative Finanzinstrumente

-5'368'931.01 -0.32

#### Futures

0.00 0.00

12/23	EURO-SCHATZ FUT DEC23	100	0	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUXL 30Y BND DEC23	-70	70	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BTP FUTURE DEC23	0	80	80	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BUND FUTURE DEC23	170	30	200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO-BOBL FUTURE DEC23	130	0	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	US LONG BOND(CBT) DEC23	-10	10	0	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 10YR ULTRA FUT DEC23	70	180	250	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 5YR NOTE (CBT) DEC23	100	0	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	US 2YR NOTE (CBT) DEC23	50	0	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUND FUTURE MAR24	0	255	255	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BOBL FUTURE MAR24	0	130	130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-SCHATZ FUT MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO-BUXL 30Y BND MAR24	0	100	100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	AUST 10Y BOND FUT MAR24	0	70	70	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 10YR ULTRA FUT MAR24	0	290	290	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LONG GILT FUTURE MAR24	0	190	190	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	CAN 10YR BOND FUT MAR24	0	100	100	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 5YR NOTE (CBT) MAR24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	US 2YR NOTE (CBT) MAR24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO-BUND FUTURE JUN24	0	260	80	180 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-BOBL FUTURE JUN24	0	240	0	240 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-SCHATZ FUT JUN24	0	100	0	100 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO-BUXL 30Y BND JUN24	0	175	100	75 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	US 10YR ULTRA FUT JUN24	0	40	20	20 USD	0.00	0.00	0.00	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.
06/24	US ULTRA BOND CBT JUN24	0	30	150	-120 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	LONG GILT FUTURE JUN24	0	185	0	185 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	80	80	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 5YR NOTE (CBT) JUN24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/24	US 2YR NOTE (CBT) JUN24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	

#### Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall	13.11.2023	6'180'000	5'939'394	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	13.11.2023	1'470'000	1'623'056	GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall	13.11.2023	17'500'000	2'160'638	CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	13.11.2023	557'430'000	3'323'364	JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	13.11.2023	17'000'000	15'281'555	USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	27.11.2023	2'000'000	2'076'908	CHF/EUR	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.04.2024	1'885'080	15'000'000	CHF/CNY	0.00	0.00	

#### Devisentermingeschäfte

**0.00 0.00**

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF	Verfall	30.11.2023	14'927'951	22'700'000	CHF/CAD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	21'789'669	19'950'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall	30.11.2023	1'504'042	60'920'000	CHF/THB	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall	30.11.2023	1'316'448	16'000'000	CHF/SEK	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	128'546'203	135'340'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	264'326'657	294'860'000	CHF/USD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	30.11.2023	7'999'740	14'000'000	CHF/AUD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	48'738'726	397'400'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	30.11.2023	450'857	5'500'000	CHF/NOK	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall	30.11.2023	1'441'179	29'050'000	CHF/MXN	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	65'284'865	10'830'000'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	30.11.2023	2'470'000	2'209'882	USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	30.11.2023	690'000	654'544	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	30.11.2023	2'460'000	2'185'211	USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	30.11.2023	150'000	161'547	GBP/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'336'196	1'500'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	2'465'780	19'940'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	6'230'991	6'490'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	1'058'578	176'050'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	582'078	530'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	12'128'983	13'390'000	CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	11'571'711	12'910'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	2'285'884	18'600'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	1'317'372	1'190'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	2'617'633	434'900'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	4'385'525	4'560'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	3'217'484	3'590'000	CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall	30.11.2023	3'770'000	465'388	CNY/CHF	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'645'057	2'530'000	CHF/CAD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'030'618	1'790'000	CHF/AUD	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	2'342'320	19'000'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	1'344'496	1'220'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	6'764'637	7'040'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	3'055'287	512'150'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	14'451'121	16'110'000	CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	12'815'699	14'200'000	CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	7'032'937	7'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	1'554'187	12'560'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	1'534'485	1'390'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	3'787'369	635'980'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'149'631	1'290'000	CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	935'238	157'930'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall	30.11.2023	1'100'574	9'000'000	CHF/CNY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.11.2023	2'275'370	2'360'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	2'142'320	2'420'000	CHF/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	1'002'141	910'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'321'614	1'490'000	CHF/USD	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'036'313	1'790'000	CHF/AUD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	30.11.2023	1'493'405	2'320'000	CHF/CAD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.11.2023	508'170	460'000	CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.11.2023	743'725	125'450'000	CHF/JPY	0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall	01.12.2023	2'218'632	39'000'000'000	CHF/IDR	0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall	01.12.2023	4'320'568	6'500'000'000	CHF/KRW	0.00	0.00	

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.
KRW/CHF	Verfall 01.12.2023		1'226'213	1'800'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 01.12.2023		8'300'000'000	5'642'700	KRW/CHF		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 01.12.2023		39'000'000'000	2'224'136	IDR/CHF		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 11.01.2024		1'350'640	16'000'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 11.01.2024		1'530'542	60'920'000	CHF/THB		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 11.01.2024		10'220'010	17'580'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.01.2024		17'740'602	27'550'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 11.01.2024		452'007	5'500'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.01.2024		76'622'417	12'872'460'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.01.2024		58'040'371	472'730'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.01.2024		28'281'999	25'500'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		156'208'338	162'400'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 11.01.2024		1'469'549	29'050'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		313'978'516	359'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'240'093	1'420'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		2'278'880	2'420'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		3'297'488	3'800'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		2'859'913	3'040'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'183'989	1'360'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.01.2024		1'697'054	278'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		4'564'560	5'280'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.01.2024		1'494'192	12'300'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		1'686'388	1'780'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 11.01.2024		1'008'339	920'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 11.01.2024		4'022'863	33'400'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'218'502	1'890'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		8'846'972	9'380'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 11.01.2024		5'131'811	854'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		19'472'436	22'680'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 11.01.2024		2'012'111	2'140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		2'908'176	3'470'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 11.01.2024		3'380'000	2'880'852	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		2'980'551	3'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'149'217	1'800'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'689'988	1'990'000	CHF/USD		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 12.01.2024		5'830'528	8'600'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 12.01.2024		2'491'168	44'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 12.01.2024		44'000'000'000	2'402'127	IDR/CHF		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 12.01.2024		8'600'000'000	5'507'747	KRW/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 21.02.2024		19'791'040	31'240'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		358'100'760	422'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 21.02.2024		87'279'290	14'750'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 21.02.2024		29'814'746	27'650'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
THB/CHF	Verfall 21.02.2024		1'482'135	60'920'000	CHF/THB		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 21.02.2024		173'710'742	187'200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 21.02.2024		1'323'952	16'000'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 21.02.2024		65'718'105	555'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 21.02.2024		9'984'579	17'580'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 21.02.2024		1'444'157	29'050'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 21.02.2024		450'225	5'500'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 21.02.2024		1'459'858	2'300'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 21.02.2024		1'079'810	1'000'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 21.02.2024		2'225'006	18'600'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 21.02.2024		1'132'853	1'780'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 21.02.2024		3'694'053	31'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 21.02.2024		7'565'724	8'100'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 21.02.2024		3'171'991	3'380'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 21.02.2024		2'284'331	390'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 21.02.2024		1'497'328	1'380'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 21.02.2024		5'073'206	863'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 21.02.2024		2'089'907	42'000'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		18'503'609	21'570'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		5'695'015	6'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 21.02.2024		3'900'000	3'378'071	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		7'379'377	8'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 21.02.2024		2'171'039	2'300'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 21.02.2024		1'939'040	16'000'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 21.02.2024		700'000	605'441	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		1'304'750	1'500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 21.02.2024		2'706'666	2'900'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 21.02.2024		2'600'000	2'273'791	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 21.02.2024		203'880'000	193'645'224	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 21.02.2024		71'050'000	3'673'484	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 21.02.2024		17'580'000	10'135'749	AUD/CHF		0.00	0.00	



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.
	CHF/THB Verfall 21.02.2024		60'920'000	1'491'992		THB/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 21.02.2024		5'500'000	462'165		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 21.02.2024		16'000'000	1'354'720		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 21.02.2024		30'030'000	33'342'309		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 21.02.2024		620'600'000	75'899'380		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 21.02.2024		35'320'000	23'088'331		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 21.02.2024		16'003'000'000	94'000'022		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2024		452'970'000	399'560'307		USD/CHF	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 22.02.2024		2'874'187	53'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 22.02.2024		5'940'586	9'300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 22.02.2024		9'300'000'000	6'110'345		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 22.02.2024		53'000'000'000	2'987'514		IDR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		191'920'995	202'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 25.03.2024		3'640'375	71'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.03.2024		10'110'785	17'580'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 25.03.2024		1'487'532	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 25.03.2024		1'351'792	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 25.03.2024		460'917	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 25.03.2024		33'233'570	30'030'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.03.2024		75'761'607	620'600'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 25.03.2024		23'018'256	35'320'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.03.2024		94'152'370	16'003'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		391'174'135	445'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		6'400'000	781'875		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		2'700'000	2'564'811		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.03.2024		467'800'000	2'746'122		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		3'100'000	2'720'479		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		5'100'000	623'261		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		1'600'000	1'521'379		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		3'600'000	3'161'963		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		1'492'564	1'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		1'438'167	1'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		1'586'416	1'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		2'014'228	2'100'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		4'392'080	5'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 25.03.2024		2'207'485	3'800'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 25.03.2024		4'645'582	37'800'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 25.03.2024		4'891'322	824'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 25.03.2024		9'156'613	9'500'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.03.2024		14'519'888	16'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.03.2024		463'200'000	416'551'128		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 25.03.2024		16'000'000	1'375'200		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 25.03.2024		71'050'000	3'816'195		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 25.03.2024		646'900'000	80'539'050		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 25.03.2024		5'500'000	463'155		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 25.03.2024		21'380'000	12'630'449		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 25.03.2024		211'300'000	206'366'145		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 25.03.2024		30'030'000	34'207'173		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 25.03.2024		16'359'200'000	97'047'682		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 25.03.2024		35'320'000	23'462'016		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/THB Verfall 25.03.2024		60'920'000	1'519'406		THB/CHF	0.00	0.00	
	KRW/CHF Verfall 26.03.2024		6'750'455	10'300'000'000		CHF/KRW	0.00	0.00	
	IDR/CHF Verfall 26.03.2024		2'968'522	53'000'000'000		CHF/IDR	0.00	0.00	
	CHF/KRW Verfall 26.03.2024		10'300'000'000	6'887'614		KRW/CHF	0.00	0.00	
	CHF/IDR Verfall 26.03.2024		53'000'000'000	3'036'466		IDR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.04.2024		412'913'893	460'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 24.04.2024		1'372'256	16'000'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 24.04.2024		3'784'933	71'050'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 24.04.2024		78'466'743	631'000'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 24.04.2024		12'598'806	21'380'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 24.04.2024		461'956	5'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 24.04.2024		205'918'189	211'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.04.2024		34'098'314	30'030'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 24.04.2024		97'168'577	16'359'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.04.2024		23'393'531	35'320'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	THB/CHF Verfall 24.04.2024		1'516'037	60'920'000		CHF/THB	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 24.04.2024		254'800'000	1'512'419		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 24.04.2024		2'100'000	2'046'477		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2024		3'600'000	3'225'982		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 24.04.2024		3'675'385	68'400'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 24.04.2024		2'317'331	27'200'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 24.04.2024		9'223'373	13'900'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 24.04.2024		13'300'654	11'700'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 24.04.2024		2'976'356	35'500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	

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.
AUD/CHF	Verfall 24.04.2024		6'888'796	11'700'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 24.04.2024		32'940'818	5'523'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 24.04.2024		25'898'299	208'800'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.04.2024		138'173'841	153'700'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 24.04.2024		67'157'194	68'800'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.04.2024		3'500'000	3'161'533	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.04.2024		664'200'000	3'986'130	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.04.2024		2'300'000	2'085'504	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 24.04.2024		11'300'000	957'415	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 24.04.2024		3'800'000	2'274'224	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 24.04.2024		41'800'000	2'300'095	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.04.2024		900'000	1'018'254	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.04.2024		7'300'000	6'632'262	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 24.04.2024		700'000	462'405	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 24.04.2024		48'520'000	32'215'824	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 24.04.2024		839'800'000	105'554'462	CNY/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 24.04.2024		97'650'000	5'190'361	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 24.04.2024		43'200'000	3'606'768	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/THB	Verfall 24.04.2024		60'920'000	1'500'581	THB/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 24.04.2024		29'280'000	17'172'134	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 24.04.2024		29'700'000	2'452'329	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 24.04.2024		20'963'300'000	123'469'644	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 24.04.2024		278'000'000	269'673'900	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 24.04.2024		40'830'000	45'883'121	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 24.04.2024		597'700'000	544'654'125	USD/CHF		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 25.04.2024		6'871'303	10'300'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
IDR/CHF	Verfall 25.04.2024		3'018'825	53'000'000'000	CHF/IDR		0.00	0.00	
KRW/CHF	Verfall 25.04.2024		2'694'231	4'040'000'000	CHF/KRW		0.00	0.00	
CHF/KRW	Verfall 25.04.2024		14'340'000'000	9'475'047	KRW/CHF		0.00	0.00	
CHF/IDR	Verfall 25.04.2024		53'000'000'000	2'971'868	IDR/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 11.06.2024		32'052'195	48'500'000	CHF/CAD		-197'485.61	-0.01	b)
MXN/CHF	Verfall 11.06.2024		5'121'323	97'650'000	CHF/MXN		-78'327.26	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 11.06.2024		1'493'688	60'900'000	CHF/THB		-8'719.03	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 11.06.2024		3'594'888	43'200'000	CHF/SEK		-4'923.79	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 11.06.2024		17'103'531	29'280'000	CHF/AUD		-275'037.03	-0.02	b)
NOK/CHF	Verfall 11.06.2024		2'441'964	29'700'000	CHF/NOK		-9'049.21	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		268'742'322	278'000'000	CHF/EUR		-3'085'684.15	-0.19	b)
JPY/CHF	Verfall 11.06.2024		123'684'122	20'960'000'000	CHF/JPY		1'320'139.75	0.08	b)
GBP/CHF	Verfall 11.06.2024		45'615'338	40'800'000	CHF/GBP		-1'032'495.86	-0.06	b)
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		541'733'165	597'700'000	CHF/USD		-3'944'790.64	-0.24	b)
CHF/EUR	Verfall 11.06.2024		1'300'000	1'267'505	EUR/CHF		3'650.15	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 11.06.2024		1'800'000	1'639'730	USD/CHF		3'616.70	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 11.06.2024		430'000'000	2'534'708	JPY/CHF		-24'382.62	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 11.06.2024		1'200'000	1'362'846	GBP/CHF		9'182.92	0.00	b)
CHF/CAD	Verfall 11.06.2024		500'000	332'613	CAD/CHF		-138.10	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 11.06.2024		1'400'000	1'365'710	EUR/CHF		3'227.86	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 11.06.2024		866'901	10'500'000	CHF/NOK		375.58	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 11.06.2024		2'868'869	492'100'000	CHF/JPY		-3'943.17	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		5'269'033	5'800'000	CHF/USD		-26'171.23	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 11.06.2024		1'490'005	2'500'000	CHF/AUD		6'131.89	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 11.06.2024		1'708'682	1'500'000	CHF/GBP		-6'362.82	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 11.06.2024		3'896'768	4'000'000	CHF/EUR		-14'474.08	0.00	b)
THB/CHF	Verfall 11.06.2024		1'672'236	68'100'000	CHF/THB		-7'798.50	0.00	b)
MXN/CHF	Verfall 11.06.2024		1'959'611	37'100'000	CHF/MXN		-15'905.45	0.00	b)
CNY/CHF	Verfall 12.06.2024		104'500'250	835'000'000	CHF/CNY		-818'287.11	-0.05	b)
CNY/CHF	Verfall 12.06.2024		1'167'857	9'300'000	CHF/CNY		-5'158.52	0.00	b)
KRW/CHF	Verfall 12.06.2024		9'446'491	14'340'000'000	CHF/KRW		-45'930.03	0.00	b)
IDR/CHF	Verfall 12.06.2024		4'057'381	73'000'000'000	CHF/IDR		-35'434.46	0.00	b)
KRW/CHF	Verfall 12.06.2024		754'689	1'150'900'000	CHF/KRW		-7'148.73	0.00	b)
IDR/CHF	Verfall 12.06.2024		1'125'567	20'198'300'000	CHF/IDR		-6'875.06	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>-8'308'197.61</b>	<b>-0.50</b>	

## Swaps

							<b>2'939'266.60</b>	<b>0.18</b>	
02/53	IRS FIX LEG 2.95024% P.A USD	-14'000	0	0	-14'000 USD	81.18%	-10'423'742.93	-0.63	b)
02/53	IRS FLOATING LEG - USD-SOFR-COMPOUND	14'000	0	0	14'000 USD	100.00	12'840'100.00	0.78	b)
03/54	IRS FIX LEG 2.3849% P.A. EUR	0	0	16'000	-16'000 EUR	96.67%	-15'167'776.23	-0.92	b)
03/54	IRS FLOATING LEG - EUR - EURIBOR 6M EUR	0	16'000	0	16'000 EUR	100.00	15'690'685.76	0.95	b)

<b>Vermögensaufstellung</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
Bankguthaben auf Sicht		25'977'665.79	1.57
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		1'618'320'049.93	97.93
Derivative Finanzinstrumente		-5'368'931.01	-0.32
Sonstige Vermögenswerte		13'577'231.54	0.82
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'652'506'016.25</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten		-180'772.13	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'652'325'244.12</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'618'320'049.93	97.93
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-13'345'842.38	-0.81
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59555135
CAD	1 = CHF	0.66757652
CNY	1 = CHF	0.12645200
COP	1'000 = CHF	0.23565000
CZK	100 = CHF	3.89529900
DKK	100 = CHF	13.14844400
EUR	1 = CHF	0.98066786
GBP	1 = CHF	1.14840937
IDR	10'000 = CHF	0.56410000
ILS	1 = CHF	0.24572332
JPY	100 = CHF	0.58281700
KRW	1 = CHF	0.00066359
MXN	1 = CHF	0.05382810
MYR	1 = CHF	0.19217391
NOK	100 = CHF	8.28190000
NZD	1 = CHF	0.54272351
PLN	1 = CHF	0.22666387
SEK	100 = CHF	8.35603500
SGD	1 = CHF	0.67252062
THB	100 = CHF	2.47477100
USD	1 = CHF	0.91715000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

<b>Engagement</b>	<b>Währung</b>	<b>Betrag</b>	<b>in % 28)</b>
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	87'137'643.03	5.274
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'231'423'189.88	74.527

## 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
ASTT CHF	CHF	-	-	-	-
NTH1 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
ASTT CHF	0.450	0.700	0.350	0.100	2.000
NTH1 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

Bloomberg Global Aggregate ex CHF TR Index Value Unhedged CHF

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

## 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 Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der 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 Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.